



INFORME DE FISCALIZACIÓN DE LA GESTIÓN DE LA TESORERÍA Y ACTIVIDAD FINANCIERA DE LA COMUNIDAD AUTÓNOMA DE CANARIAS, EJERCICIOS 2011-2014

10 DE DICIEMBRE DE 2015

El Pleno de la Audiencia de Cuentas de Canarias, en el ejercicio de la función fiscalizadora establecida en el artículo 5.1 de la Ley 4/1989, de 2 de mayo, y a tenor de lo previsto en el artículo 18 de la misma disposición y concordantes del Reglamento de Organización y Funcionamiento, ha aprobado, en su sesión de 10 de diciembre de 2015, el Informe de Fiscalización de la gestión de la Tesorería y actividad financiera de la Comunidad Autónoma de Canarias, ejercicios 2011-2014. Asimismo, de acuerdo con lo previsto en el artículo 19 de la Ley 4/1989, ha acordado su elevación al Parlamento de Canarias, al Tribunal de Cuentas, a la Intervención General de la Administración de la Comunidad Autónoma de Canarias y a la Dirección General del Tesoro y Política Financiera.

**INFORME DE FISCALIZACIÓN DE LA GESTIÓN DE LA
TESORERÍA Y ACTIVIDAD FINANCIERA DE LA
COMUNIDAD AUTÓNOMA DE CANARIAS, EJERCICIOS
2011-2014**

ÍNDICE

Pág.

ABREVIATURAS, SIGLAS Y ACRÓNIMOS		3
1. INTRODUCCIÓN		4
1.1. Justificación.		4
1.2. Objetivos.		4
1.3. Alcance.		5
1.4. Marco Jurídico.		5
2. EL TESORO DE LA COMUNIDAD AUTÓNOMA DE CANARIAS (CAC)		7
2.1. Grado de cumplimiento de las recomendaciones prescritas en el Informe de Fiscalización de la Actividad Financiera y de la Tesorería de la Comunidad Autónoma, ejercicio 2002.		8
2.2. Análisis de los procedimientos de gestión de la tesorería de la CAC.		12
2.2.1 Actas de arqueo, estado de situación de fondos y cuentas corrientes.		12
2.2.2. El Registro de cuentas de la tesorería de la CAC.....		13
2.2.3. Contraste de información con las entidades financieras.....		14
2.2.4. Las conciliaciones bancarias.....		15
2.3. Análisis del Periodo Medio de Pago (PMP).....		17
2.3.1. Antecedentes normativos.		17
2.3.2. El registro de facturas.		20
2.3.3. Tabla evolución método de cálculo del periodo medio de pago.....		21
2.3.4 Comparación datos PMP años 2013-2014.		22
2.4. Anticipos de tesorería a empresas.....		23

2.5. Presupuestos de tesorería, liquidez y endeudamiento.	24
2.6. Análisis financiero de la financiación ajena.	26
2.6.1 Préstamos.....	26
2.6.2 Deuda pública.....	31
2.7. Rendimiento obtenido por la bonificación en el pago de las retenciones del IRPF.	31
2.8. Análisis del rendimiento de los depósitos y cuentas corrientes operativas.....	34
3. TRAMITE DE ALEGACIONES	40
4. CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES	41
4.1. Conclusiones.	41
4.2. Recomendaciones.	43
ANEXOS	44
ANEXO I. Tipos de interés de los PRÉSTAMOS contratados en el periodo 2011-2014 en los mercados europeo y español	45
ANEXO II. Tipos de interés de la DEUDA contratada en el periodo 2011-2014 en los mercados europeo y español.....	55
ANEXO III. Rendimientos obtenidos por los intereses producidos por los saldos medios de las cuentas operativas de la CAC en el periodo 2011-2014.....	221
ANEXO IV: Contestación a las alegaciones.....	249

ABREVIATURAS, SIGLAS Y ACRÓNIMOS

CAC	Comunidad Autónoma de Canarias.
D.G.	Dirección General.
ESF	Estado de Situación de Fondos.
FLA	Fondo de Liquidez Autonómico.
IBAN	Código Internacional de Cuenta Bancaria. (International Bank Account).
ICO	Instituto de Crédito Oficial.
IGCAC	Intervención General de la Comunidad Autónoma de Canarias.
IPA	Ingresos pendientes de aplicar.
ISF	Ingresos sin formalizar.
LHPC	Ley Hacienda Pública Canaria.
NIF	Número de Identificación Fiscal.
OEC	Ordenes en circulación.
OO.AA	Organismos Autónomos.
PICCAC	Plan Informático Contable de la Comunidad Autónoma de Canarias.
PMP	Periodo medio de pago.
PSF	Pagos sin formalizar.
RIC	Reserva de Inversión en Canarias.
SEFCAN	Sistema de información para la gestión económico- financiera de la Comunidad Autónoma de Canarias.
SEFlogiC	Sistema de información económico-financiera y logística de la Comunidad Autónoma de Canarias.
TARO	Sistema de información para la gestión económico-financiera del Servicio Canario de la Salud.
TAYA	Tesorería Análisis y Aplicaciones.

1. INTRODUCCIÓN

La Audiencia de Cuentas de Canarias realizó, en el año 2002, una fiscalización que puso de manifiesto diversas irregularidades y disfunciones en la gestión de la tesorería de la CAC. La situación actual del Tesoro de la CAC, trece años después, es radicalmente diferente. El nivel de tecnificación y el control interno de esta gestión ha mejorado ostensiblemente.

La dotación de medios técnicos y personales de la D. G. del Tesoro y Política Financiera, así como la organización del trabajo y funciones del centro directivo, ha evolucionado sustancialmente, respecto a la situación existente en el año 2002.

1.1. Justificación.

En virtud de lo dispuesto en el artículo 1 de la Ley 4/1989, de 2 de mayo, a la Audiencia de Cuentas de Canarias le corresponde la fiscalización externa de la gestión económica, financiera y contable del sector público de la Comunidad Autónoma de Canarias.

El Programa de Actuaciones de la Audiencia de Cuentas para el ejercicio 2015, aprobado por el Pleno en sesión celebrada el 19 de diciembre de 2014, se incluye la "Fiscalización de la gestión de la Tesorería y actividad financiera de la Comunidad Autónoma de Canarias, ejercicios 2011-2014".

En ejecución del Programa Anual de Actuaciones para 2015 se ha elaborado el presente Informe, atendiendo a las ISSAI-ES aprobados por el Pleno de la Audiencia de Cuentas de Canarias, los Principios y Normas de Auditoría del Sector Público (PNASP) y las Instrucciones y Normas Internas de Fiscalización de la Audiencia de Cuentas de Canarias.

1.2. Objetivos.

La actuación fiscalizadora a realizar consiste en una auditoría de tipo operativo (eficacia, eficiencia y sistemas y procedimientos) que tiene como objetivos los siguientes:

- Determinar el grado de cumplimiento de las recomendaciones prescritas en el Informe de Fiscalización de la Actividad Financiera y de la Tesorería de la Comunidad Autónoma, ejercicio 2002, así como, verificar las mejoras de gestión y control de la tesorería de la CAC habidas hasta la fecha.

- Realizar una evaluación, de carácter financiero, sobre los costes de la financiación ajena de la CAC y el rendimiento que producen los saldos de las cuentas corrientes y depósitos del Tesoro de la CAC.
- Analizar los procedimientos de gestión de la tesorería y de la actividad financiera del Tesoro de la CAC.

1.3. Alcance.

La fiscalización se refiere a los ejercicios 2011 a 2014.

El alcance de la presente fiscalización comprendió lo siguiente:

- a. Comprobar el grado de corrección de las disfunciones señaladas en el informe elaborado por esta Institución, referido al ejercicio 2002.
- b. Análisis de los procedimientos de gestión de la tesorería de la CAC identificación de riesgos y controles automáticos.
- c. Analizar los procesos de ordenación de pagos, su relación con el cálculo del periodo medio de pago y el efecto que en ello ha tenido el Mecanismo de Pago a Proveedores y el Fondo de Liquidez Autonómico (FLA).
- d. Análisis financiero de la financiación ajena de la CAC y del rendimiento de los saldos bancarios.

El trabajo se llevó a cabo de acuerdo con los Principios y Normas de Auditoría del Sector Público (ISSAI) para los Órganos de Control Externo y en lo no contemplado en los mismos, con las Normas de Auditoría generalmente aceptadas. No obstante, la naturaleza de esta fiscalización, recomienda la exceptuación de la aplicación de las Normas Internas de Fiscalización, en lo referido a aspectos formales de presentación del Informe, así como en los procedimientos y pruebas para sustentar las conclusiones, que difieren de los métodos y procedimientos utilizados en las fiscalizaciones de regularidad, quedando excluida las comprobaciones de legalidad.

La fecha de terminación de los trabajos de fiscalización fue el 19 de octubre de 2015.

1.4. Marco Jurídico.

- Ley 47/2003, de 26 de noviembre, General Presupuestaria.
- Ley 11/2006, de 11 de diciembre, de la Hacienda Pública Canaria.
- Ley 9/2014, de 6 de noviembre, de medidas tributarias, administrativas y sociales de Canarias.
- Real Decreto-ley 21/2012, de 13 de julio, de medidas de liquidez de las Administraciones públicas y en el ámbito financiero.

- Real Decreto 635/2014, de 25 de julio, por el que se desarrolla la metodología del cálculo del periodo medio de pago a proveedores de las Administraciones públicas y las condiciones y el procedimiento de retención de recursos de los regímenes de financiación, previstos en la Ley Orgánica 2/2012, de 27 de abril, de estabilidad presupuestaria y sostenibilidad financiera.
- Decreto 12/2004, de 10 de febrero, se aprueba el Reglamento Orgánico de la Consejería de Economía y Hacienda.
- Decreto 2/2014, de 23 de enero, por el que se crea y regula el Registro de Facturas del sector público autonómico de Canarias con presupuesto limitativo.

2. EL TESORO DE LA COMUNIDAD AUTÓNOMA DE CANARIAS (CAC)

Tal como se recoge en el artículo 82 de la Ley 11/2006, de 11 de diciembre, de la Hacienda Pública Canaria, constituyen el Tesoro de la CAC todos los recursos financieros, sean dinero, valores o créditos de los entes del sector público con presupuesto limitativo a que se refiere el número 1 del artículo 3 de esta Ley, tanto por operaciones presupuestarias como no presupuestarias.

Según el artículo 83 de la citada Ley 11/2006, son funciones encomendadas al Tesoro:

- a. *“Custodiar los fondos, pagar las obligaciones de la Comunidad Autónoma de Canarias y recaudar sus derechos.*
- b. *Servir al principio de unidad de caja, mediante la centralización de todos los fondos y valores generados por operaciones presupuestarias y no presupuestarias.*
- c. *Distribuir en el tiempo y en el territorio las disponibilidades necesarias para la puntual satisfacción de las obligaciones de la Comunidad Autónoma de Canarias.*
- d. *Responder de los avales contraídos por la Comunidad Autónoma de Canarias según las disposiciones de esta Ley.*
- e. *Emitir, contraer y gestionar la Deuda de la Comunidad Autónoma de Canarias y ejecutar las operaciones financieras relativas a la misma.*
- f. *Realizar las demás funciones que se deriven o relacionen con las anteriormente enumeradas.”*

Finalmente se debe señalar que el marco temporal objeto de esta fiscalización (2011-2014), ha coincidido con un periodo de gran transformación del sector bancario en España. Se han producido muchas fusiones y absorciones entre las diversas entidades financieras, asimismo, se ha producido un proceso de fusión y desaparición de las Cajas de Ahorro, transformándose en Bancos. Todo ello ha repercutido en la gestión y control de las cuentas y depósitos que la Tesorería de la CAC ha mantenido en este tiempo. Ha sido especialmente complejo el seguimiento de cuentas que desaparecían y se transformaban en otra de distinta entidad.

Esta realidad, unida al elevado número de cuentas operativas que utiliza el Tesoro de la CAC (56 cuentas en 2011, 34 cuentas en 2014; según el ESF), ha generado alguna dificultad para la identificación y justificación de operaciones concretas, no obstante, el trabajo de campo desarrollado y la documentación analizada permiten obtener conclusiones y recomendaciones, con evidencia suficiente.

2.1. Grado de cumplimiento de las recomendaciones prescritas en el Informe de Fiscalización de la Actividad Financiera y de la Tesorería de la Comunidad Autónoma, ejercicio 2002.

Las recomendaciones formuladas en el informe del año 2002, derivaban de las siguientes carencias y debilidades de control detectadas en aquel entonces:

- Retraso o inexistencia de conciliaciones de los saldos bancarios de manera sistemática y actualizada.
- Descontrol de la gestión de las cuentas corrientes en lo referido a su apertura, seguimiento, registro de claveros, etc.
- Problemática de reflejo contable de los cargos y abonos de las pólizas de crédito.

Se recomendaba reforzar el control en las siguientes áreas:

- Fiscalización de las conciliaciones.
- Verificación del correcto ingreso de los rendimientos por bonificación del Impuesto sobre la Renta de las Personas Físicas, y que éstos sean los adecuados.
- Verificación del correcto ingreso de los rendimientos por depósitos de cuentas corrientes, y que éstos son los apropiados.
- Comprobación de la ausencia de efectivo en el Estado de Situación de Fondos en las disposiciones de crédito.
- Verificación del control de aperturas y rescisión de las cuentas corrientes.

Así mismo, se recomendaba la adopción de medidas de coordinación en la gestión de las pólizas de crédito, el endeudamiento, la aplicación de los ingresos, entre la D.G. del Tesoro y Política Financiera, la D.G. de Presupuestos y la Intervención General. También se recomendaba que se dotara a la D.G. del Tesoro y Política Financiera de los medios técnicos e informáticos adecuados para soportar de gestión de las funciones que tenía asignadas.

En la actualidad, la estructura, organización, funcionamiento y controles internos de la Tesorería de la CAC presentan una fortaleza y calidad muy superior a la que mostraba en el año 2002. Las mejoras alcanzadas en esta materia se pueden resumir en los siguientes aspectos:

a) Adecuación de la normativa de la Administración Autonómica, a las recomendaciones del informe de fiscalización del año 2002.

Las diversas recomendaciones del informe de fiscalización del año 2002, se han ido recogiendo a lo largo de estos años en la generación de normativa de la Administración Autonómica.

Claro ejemplo de dicho seguimiento, lo encontramos en la Orden de la Consejería de Economía, Hacienda y Seguridad, de 22 de Julio 2004, por la que se regula el régimen de funcionamiento y gestión de las cuentas bancarias y de los fondos integrantes en la tesorería de la C.A.C. y sus OO.AA. Destacar de esta Orden:

1. A través de la ejecución de la misma se logra una mayor eficacia y transparencia en la gestión de las cuentas corrientes, en el control y disposición de los fondos, naturaleza y autorización.
2. En dicha Orden se definen, respecto a las cuentas corrientes de la Administración de la CAC, la naturaleza y autorización de las cuentas y los servicios de colaboración a concertar con el Banco de España y las entidades de crédito que operan en Canarias. Así, en el artículo 3º de la citada Orden, se recoge los distintos tipos de cuentas, dando lugar a una situación de orden, control y localización inmediata de los tipos de ingresos.
3. Asimismo, a través de los convenios de colaboración se han determinado las condiciones financieras de los fondos situados en las cuentas corrientes, así como pactar las prestaciones de los servicios de tesorería entre otros. Ello ha posibilitado realizar los siguientes procesos de control interno:
 - Verificación del correcto control y supervisión de los ingresos correspondientes a los rendimientos por bonificación del Impuesto sobre la Renta de las Personas Físicas.
 - Verificación del correcto ingreso de los rendimientos por depósitos de cuentas Corrientes.
 - Verificación del control y apertura y rescisión de cuentas corrientes.
 - Verificación muestral de los movimientos internos de Tesorería.
 - Comprobación de la ausencia de efectivo en el Estado de Situación de Fondos en las disposiciones de crédito.

b) Implantación de Sistemas Informáticos, los cuáles se adecuan a las recomendaciones del informe de fiscalización del año 2002.

Una de las primeras medidas tomadas, respecto a la recomendación relativa a las conciliaciones bancarias, fue en el sistema contable vigente hasta el 2009 PICACC, en el que se implementó un módulo específico denominado “Conciliaciones bancarias”, a través del cual se llevaba a cabo, y se siguió llevando hasta la implantación de los nuevos sistemas contables, un seguimiento y control de las conciliaciones bancarias, con un nivel de automatización e informatización, que permitió, a partir de su implementación, la depuración, identificación y regularización de todos los apuntes pendientes de conciliación, de forma periódica y rápida.

Mediante el Decreto 146/2009, de 24 de noviembre, de aprobación y puesta en funcionamiento del sistema de información para la gestión económica-financiera de la CAC (SEFCAN) y para la gestión económica-financiera del Servicio Canario de Salud (TARO), se sustituyó el PICCAC por estos nuevos sistemas.

Finalmente, el Decreto 127/2014, de 23 de diciembre, de aprobación e implantación del sistema de información económico-financiera y logística de la CAC, con la denominación de SEFLogiC (BOC nº 253, de 31.12.2014.), que sustituyó al SEFCAN y al TARO. La experiencia obtenida en el tiempo transcurrido desde la implantación de los sistemas de información SEFCAN y TARO puso de manifiesto que, para continuar en la senda de obtención de mejoras de los principios de buena gestión financiera, procedía realizar las actuaciones oportunas que permitieran culminar con la convergencia de ambos sistemas, SEFCAN y TARO, en un único sistema de información para la gestión económico-financiera y logística para todo el Sector Público Autonómico.

Este proceso se ve culminado con la modificación legislativa propiciada por el artículo 8 de la LEY 9/2014, de 6 de noviembre, de medidas tributarias, administrativas y sociales de Canarias, que modifica el artículo 70 de la Ley 11/2006, de 11 de diciembre, de la Hacienda Pública Canaria, en los siguientes términos:

“Artículo 70.- Ordenación y ejecución material del pago.

1. Corresponderá a la dirección general competente en materia de tesoro la ordenación general y materialización de pagos de los entes del sector público con presupuesto limitativo a que se refiere el apartado 1 del artículo 3 de esta ley, tanto por operaciones presupuestarias como extrapresupuestarias”.

En un escenario como el actual de restricciones presupuestarias importantes, de obligación de cumplimiento de unos ratios de Deuda Pública y de plazos para el pago a los acreedores, la gestión óptima de la liquidez, recomendaba esta medida de centralización de la Tesorería de todos los entes públicos de la CAC, sometidos a presupuestos limitativos.

c) Otras actuaciones de la Dirección General del Tesoro y Política Financiera.

Desde el ejercicio 2008, la Dirección General, ha mantenido un contrato de servicios con sus respectivas prórrogas hasta la actualidad, con la empresa “Tesorería, Análisis y Aplicaciones, SA” (TAyA), cuyo objetivo ha sido y es la implementación, soporte y mantenimiento, de un sistema de Gestión de Tesorería, implantado en este Centro Directivo desde dicho ejercicio 2008. Las Funcionalidades o componentes de dicho aplicativo son:

- TAYa Tesorería: Gestión de extractos: Integración diaria del cuaderno 43 (extracto bancario) de todas las cuentas corrientes de todos los entes con presupuesto limitativo y estimativo que forman el sector público autonómico.
- TAYa Conciliación Única: Control administrativo de la Tesorería: se comprueba que todos los movimientos cargados o abonados por las entidades financieras corresponden a hechos reales de la Administración.

A su vez, se efectúa un control exhaustivo para comprobar que todos los movimientos contabilizados en las cuentas de bancos tengan un reflejo real en las entidades financieras, es decir, la conciliación bancaria. Con la implantación del SEFCAN en el 2010, y sólo para el caso de la Administración de la CAC, las conciliaciones bancarias se empezaron a llevar en el aplicativo TAYa, realizándose en la actualidad por SEFLogiC.

- TAYa XLA: Elaboración y seguimiento de presupuestos de tesorería: Elaboración y seguimiento de los presupuestos de tesorería, entrada de operaciones, funciones e informes personalizados en MS Excel, habiéndose implementado, en este componente, el modelo y contenido del presupuesto de tesorería, de acuerdo a las exigencias legales contenidas en la Ley Orgánica 2/2012, de 27 de abril, de Estabilidad Presupuestaria y Sostenibilidad Financiera, así como en la Orden HAP/2105/2012, de 1 de octubre, por la que se desarrollan las obligaciones de suministro de información previstas en dicha Ley. Por tanto, se emite desde este aplicativo el Presupuesto de Tesorería que, periódicamente, se ha de rendir al Estado, al objeto de cumplir con eficacia, con la instrumentación del principio de transparencia establecido en las citadas normas.
- TAYa Decisiones: Desde este componente se efectúa, por un lado, el cálculo y seguimiento de las liquidaciones de intereses de cuentas bancarias, y las inversiones financieras de excedentes de tesorería, en su caso. Por otro lado, en este mismo componente se realiza la Gestión de operaciones de endeudamiento de la Comunidad Autónoma de Canaria. La incorporación en el aplicativo TAYa de las operaciones vivas de endeudamiento, se produjo durante el ejercicio 2013.
- Cuadro de Mando Operativo y TAYa informes: Informes de seguimiento tanto de carácter estándar como personalizado mediante la utilización de un generador de informes basado en Business Objects.
- Cuadro de Mando Directivo: Representación de un conjunto de informes, gráficos e indicadores, que proporcionen una visión global de la Tesorería esencial para la realización de las actividades directivas de diagnóstico y control de la Tesorería.
- TAYa Planificación: Obtención del Plan de Tesorería, a partir de un Presupuesto Económico con datos anualizados, al que se le aplican una serie de reglas de distribución temporal, así como una serie de reglas de deslizamiento temporal, en función de los plazos de cobro y pago de cada una de las partidas

presupuestarias que lo componen, o bien a partir de previsiones de Tesorería mensuales. Las reglas a aplicar tienen la flexibilidad suficiente para adaptarse a las características de cualquier partida presupuestaria.

Tanto el Plan de Tesorería como la Posición de Tesorería están vinculados a través de una serie de reglas de gestión de las diferencias, que permiten actualizar el Plan de Tesorería con la evolución del materializado de tesorería y, al mismo tiempo, trasladar a la Posición de Tesorería las previsiones de los próximos meses establecidas en el Plan de Tesorería. Es decir, ambos instrumentos están vinculados.

Estas dos características, flexibilidad y vinculación, permiten alcanzar el objetivo del Proceso de Planificación al establecer posibles escenarios de liquidez futuros de la Administración, tanto en el día a día como al plazo de un año, de una manera dinámica.

Esto permite, igualmente, la planificación de los compromisos de pagos, debiéndose adecuar, el ritmo de éstos, a la ejecución del plan de tesorería consolidado, de modo que la gestión financiera se alinee con la protección de los proveedores, elaboración y seguimiento del plan, entrada de operaciones, funciones e informes personalizados en Excel, herramientas de optimización y simulación.

2.2. Análisis de los procedimientos de gestión de la tesorería de la CAC.

2.2.1 Actas de arqueo, estado de situación de fondos y cuentas corrientes.

El acta de arqueo es el informe contable que resume, desglosado por áreas y agrupaciones contables, el movimiento de fondos de una administración pública, en el periodo de tiempo al que se refiera. Generalmente, mensual o anual.

El total de existencias finales que este informe arroja, debe coincidir con el desglose por entidades financieras y cuentas corrientes, más el metálico existente, que figuran en el informe denominado “estado de situación de fondos”. Ambos informes reflejan el total de existencias contables de tesorería, al cierre del periodo al que se refiera. En el acta de arqueo, partiendo de las existencias iniciales del periodo, se reflejan los cobros y pagos, para obtener las existencias finales. El estado de situación de fondos recoge el desglose de estas existencias finales por Bancos y cuentas corrientes.

Sin embargo, en todos los ejercicios del periodo fiscalizado, existen diferencias entre ambos informes, tal como se puede apreciar en el cuadro siguiente:

COMPARATIVA ACTAS ARQUEO Y SITUACION DE FONDOS 2011-2014				
	2011	2012	2013	2014
(A) EXISTENCIAS TOTALES ACTA DE ARQUEO.	541.533.015,87	279.080.340,50	709.104.287,80	692.738.993,71
EXISTENCIAS ACTA DE ARQUEO SIN HABILITACIONES.	525.730.948,54	271.856.225,12	702.279.898,42	692.738.993,71
EXISTENCIAS ACTA ARQUEO HABILITACIONES.	15.802.067,33	7.224.115,38	6.824.389,38	0
(B) IMPORTE ESTADO SITUACION DE FONDOS. (SALDO CONTABLE).	504.006.702,05	279.006.824,57	709.089.287,80	698.831.657,69
DIFERENCIA (A-B)	37.526.313,82	73.515,93	15.000,00	-6.092.663,98

Además, es preciso señalar que el acta de arqueo del cierre del ejercicio 2014, expresa que las existencias finales de las habilitaciones de pago ascienden a cero Euros, sin embargo, en el estado de situación de fondos las cuentas de dichas habilitaciones figuran con saldos finales superiores a cero Euros.

En fase de alegaciones, la Dirección General del Tesoro y Política Financiera pone de manifiesto que el nuevo sistema de información SEFLOGIC permitirá obtener todos los informes de tesorería con la misma metodología, lo que dará lugar a obtener cifras homogéneas y comparables.

2.2.2. El Registro de cuentas de la tesorería de la CAC.

El artículo 16 de la Orden de 22 de julio de 2004, de la Consejería de Economía y Hacienda, por la que se regula el régimen de funcionamiento y gestión de las cuentas bancarias y de los fondos integrantes en la Tesorería de la Comunidad Autónoma y sus Organismos Autónomos (Orden 22/7/2004), establece que: “ *La Dirección General del Tesoro y Política Financiera llevará un Registro de Cuentas corrientes bancarias de la Tesorería, gestionado por el Servicio competente en materia de tesorería, en el que se inscribirán todas aquellas cuya existencia o apertura haya sido autorizada por la misma, con indicación de:*

- a. *Denominación y titularidad de la cuenta, indicando el N.I.F. al que está adscrito la cuenta, e IBAN.*
- b. *Identificación, mediante el código cuenta cliente normalizado y los datos a que se refiere el mismo.*
- c. *Tipo, conforme a lo establecido en el artículo 5 de la presente Orden.*
- d. *Destino o finalidad, con mención a las disposiciones que se hubieran establecido sobre el funcionamiento de la cuenta.*
- e. *Órgano a cuya disposición se encuentra o esté adscrita la cuenta y dirección a efectos de notificaciones.*
- f. *Persona, o personas, responsables de su gestión y custodia, indicando el N.I.F. y el puesto de trabajo que ocupa/n; en caso de Habilitación, indicación del código de identificación del Sistema contable P.I.C.C.A.C.*

- g. Resolución de nombramiento de los firmantes.*
- h. Importes máximos a que se encuentra limitada su gestión y los términos particulares en que se haya autorizado.”*

De la fiscalización realizada se ha podido constatar que el Registro existente no refleja las indicaciones reguladas por los apartados c), d), f), g), y h), del artículo 16 aquí mencionado. Sería deseable la informatización de la llevanza de este registro, manifestándose por la Dirección General del Tesoro y Política Financiera, en fase de alegaciones, que se están realizando gestiones para desarrollarlo en el SEFLOGIC.

2.2.3. Contraste de información con las entidades financieras.

Por primera vez en el ejercicio de las funciones de control, tanto interno como externo, en el ámbito de la Tesorería de la CAC, se ha realizado una circularización con todos los Bancos y Entidades Financieras, con establecimiento en Canarias, según información obtenida del Banco de España.

Para ello, se solicitó de la D.G. del Tesoro y Política Financiera, que remitiera a los Bancos un modelo de escrito, en el que se solicitaba que se entregara a la Audiencia de Cuentas información detallada de las posiciones de la Tesorería de la Administración de la CAC en cada entidad.

El detalle de la información demandada se concretó en lo siguiente:

- Cuentas corrientes y otras.
- Cuentas a plazo y depósitos.
- Cuentas canceladas.
- Financiación concedida.
- Autorización de firmas.
- Otra información. Cualquier otra cuenta, saldo o información no incluida en los apartados anteriores que consideren de interés.

Esta prueba de auditoría ha sido muy compleja por la variedad de información que se generó, la diversidad de formatos en los que se respondió a la petición de información, la tardanza de algunos Bancos en atender la demanda de información (más de dos meses en algunos casos), etc. No obstante, es preciso señalar la conveniencia de realizar esta prueba con periodicidad anual, por parte del control interno o de la propia D. G. del Tesoro y Política Financiera. Ello redundará en fortalecer la fiabilidad de los datos que contiene la rendición de cuentas de la Administración Autónoma.

Las conclusiones más relevantes obtenidas con esta prueba se resumen en lo siguiente:

- Existencia de un elevado número de cuentas bancarias sin movimientos y con saldo igual a cero.
- En la relación de firmantes que figuran de las cuentas de la Tesorería que proporcionan las Entidades financieras, figuran varias personas que ya no trabajan en la D.G. del Tesoro, algunas de ellas incluso jubiladas.
- Existen algunas cuentas de recaudación que no figuran en el sistema TAYA de la D.G. del Tesoro y Política Financiera, por ejemplo esto ocurre con el DEUTSCHE BANK. Como es sabido, en la CAC las funciones de recaudación son ejercidas por la D.G. de Tributos (ahora por la Agencia Tributaria Canaria). Periódicamente, el producto de la recaudación de esas cuentas se vierte en cuentas operativas de la tesorería de la CAC, generalmente en la misma entidad que tiene la cuenta de recaudación. Sin embargo en ocasiones ese vaciado de la cuenta de recaudación se realiza en otra entidad financiera, en cuyo caso la cuenta de recaudación nunca aparece entre las que trata el sistema TAYA.
- Las cuentas de las habilitaciones de pago, en la entidad BANKIA, que figuran en el Estado de Situación de Fondos de 2014 (34 cuentas) no aparecen en la información proporcionada por el Banco. Tampoco se ha podido confirmar, en la información ofrecida por BANKIA, la relación de cuentas de los centros docentes y comedores escolares (700 cuentas), ni las de recaudación. La información de BANKIA tuvo entrada en la Audiencia de Cuentas el 9 de septiembre de 2015, con más de dos meses de dilación desde que la misma se solicitó.

2.2.4. Las conciliaciones bancarias.

La gestión de las conciliaciones de los saldos contables de todas las cuentas corrientes operativas, con los saldos reales, según extracto, de las entidades financieras, se realiza a diario por la correspondiente unidad de la D.G. del Tesoro y Política Financiera. Cada día, mediante procesos telemáticos, se reciben los movimientos de las cuentas del día anterior, de todos los Bancos. Esta información es procesada por TAYA y se identifican las operaciones de pagos y cobros que no están conciliadas. Estas operaciones son tratadas por el personal de la Dirección General, a fin de solventar la incidencia de conciliación. Ha de resaltarse que el artículo 15.4 de la Orden de 22/7/2004, establece que *“Deberá conciliarse mensualmente el saldo del Libro de Bancos con el saldo de extracto bancario correspondiente”*, y se ha constatado que este proceso se ejecuta diariamente, lo cual representa un progreso importante respecto a situaciones anteriores.

De las pruebas de auditorías realizadas se puede afirmar que el proceso de conciliación de los saldos bancarios de las cuentas del Tesoro de la CAC, con el saldo de

cada cuenta corriente operativa, según la contabilidad de la Administración de la CAC, es sólido, fiable y consistente.

Al analizar la conciliación bancaria al cierre del ejercicio 2014 se observó lo siguiente:

A 31.12.14, el saldo bancario del total de las 25 cuentas corrientes ascendía a un importe de 707.977.876,84 euros, y el saldo contable de las mismas ascendía a 692.738.993,71 euros y que, la diferencia entre ambos de 15.238.883,13 euros, está motivada por las partidas pendientes que quedaron a dicha fecha, las cuáles se resumen y operan de la siguiente forma:

Saldo banco 31.12.14	707.977.876,84 Euros	Nº movimientos pendientes 31.12.13
- OEC: órdenes en circulación.	-15.238.883,13	1.204
+ PSF: pagos sin formalizar.	0	0
- ISF: ingresos sin formalizar.	0	0
+ IPA: ingresos pendientes de aplicar.	0	0
S. Contable 31.12.2014	692.738.993,71	
	Total de movimientos pendientes	1.204

Con la entrada en funcionamiento del nuevo sistema de convergencia TARO/SEFCAN, denominado SEFLogiC, se pretendía que la totalidad de las cuentas corrientes terminaran el ejercicio 2014 con el saldo real igual al contable, es decir sin ninguna partida pendiente de conciliar, de cara a empezar en el nuevo sistema con un menor número de cuentas corrientes y con los saldos contables a migrar coincidentes con el real. Esto además, era un objetivo prioritario para la Dirección General del Tesoro y Política Financiera, debido a dos motivos:

1. Centralización de la Tesorería de todos los entes del sector público autonómico con presupuesto limitativo (CAC y OOAA), con la consiguiente centralización de los pagos a partir de enero de 2015.
2. Las conciliaciones bancarias se realizan, a partir del ejercicio 2015, dentro del propio sistema contable SEFLogiC, y no como se venían efectuando desde la implantación del SEFCAN, a través del aplicativo TAYA, en el cuál se han conciliado, desde el 01.01.2010 hasta el 31.12.2014, los saldos de las cuentas corrientes operativas de la CAC.

Para conseguir dicho objetivo, al tener en cuenta los días no hábiles de final del ejercicio de 2014, a efectos de los procesos informáticos de envíos de ficheros de EDITRÁN (tanto del cuaderno 34-pagos, como del cuaderno 43-extractos), se estableció, por parte del Servicio del Tesoro, como último día de pago generalizado a proveedores,

el 26.12.2014. No obstante, se produjo una incidencia con varios de los ficheros de pagos (cuaderno 34) emitidos en dicha fecha 26.12.2014, concretamente, con los correspondiente a la entidad CAJAMAR (Caja Rurales unidas), los cuáles no fueron procesados, por la misma en diciembre, sino en enero, entre los días 14 y 23 de enero, y que contenían 1.204 operaciones de pago. Estas son las 1.204 órdenes en circulación (OEC) que quedaron pendientes al final del ejercicio 2014. No pudieron procesarse con anterioridad debido a la imposibilidad de su identificación hasta que los sistemas contables estuvieran operativos (SEFCAN en consulta, y SELogiC), que no fue hasta mediados de enero, y poder además identificar las operaciones afectadas en el aplicativo TAYA, al tratarse de operaciones contables del 2014, pero procesadas por la entidad financiera en el 2015.

Esta incidencia no tiene mayor trascendencia de cara a justificar la conciliación, a fecha 31.12.2014, de la cuenta corriente afectada (identificada con el nº: ES68 3058 6100 98 2738120187 de CAJAMAR y banco propio en el sistema contable como CMAR2), en tanto en cuanto, la elaboración y emisión de dicha conciliación, una vez procesados los ficheros, se realiza y se emite en el aplicativo TAYA. Todas las operaciones afectadas por la incidencia descrita figuran conciliadas con fecha 23.01.2015.

De acuerdo con lo expuesto, se puede concluir que, al cierre del año 2014, todas las cuentas operativas de la CAC quedaron totalmente conciliadas, es decir sin partidas pendientes, a excepción de la cuenta indicada.

Total movimientos e importes conciliados en el ejercicio 2014:

	Nº MVMOTOS.	COBROS	PAGOS
Mvtos. Bancos	107.226	17.135.260.482,89	17.092.291.052,70
Mvtos. Contables	222.163	16.777.521.927,01	16.017.890.276,48

2.3. Análisis del Periodo Medio de Pago (PMP).

2.3.1. Antecedentes normativos.

La Ley 3/2004, de 29 de diciembre, por la que se establecen medidas de lucha contra la morosidad en las operaciones comerciales, transpuso a nuestro ordenamiento jurídico las medidas de lucha contra la morosidad en las operaciones comerciales establecidas por la Directiva 2000/35/CE, del Parlamento Europeo y del Consejo, de 29 de junio de 2000. La citada ley ha sido objeto de diversas modificaciones para incorporar los cambios introducidos por la normativa de la Unión Europea en materia de lucha

contra la morosidad, siendo la última modificación la operada por la reciente Ley 11/2013, de 26 de junio.

Entre las modificaciones introducidas por la citada Ley se encuentra la precisión de los plazos de pago así como el cómputo de los mismos, con la novedad de la previsión del procedimiento de aceptación o de comprobación, que se regulan para impedir su utilización con la finalidad de retrasar el pago.

La normativa señalada establece el deber de información trimestral pública sobre el cumplimiento de los plazos para pagar. Así mismo, se establece el deber de abonar al contratista, a partir del vencimiento del plazo de pago, los intereses de demora y la indemnización por los costes de cobro en los términos previstos en la Ley 3/2004.

Por la Ley Orgánica 9/2013, de 20 diciembre de Control de Deuda Comercial en el Sector Público se establece, asimismo, la obligación de la publicación del periodo medio de pago de la deuda comercial, señalando que: *“Transcurrido un mes desde la entrada en vigor de esta ley, todas las Administraciones Públicas y sus entidades y organismos vinculados o dependientes publicarán en su portal web su periodo medio de pago a proveedores e incluirán en su plan de tesorería inmediatamente posterior a dicha publicación las medidas de reducción de su periodo medio de pago a proveedores para cumplir con el plazo máximo de pago previsto en la normativa sobre morosidad.”*

Durante el ejercicio 2014 se ha dado cumplimiento a la obligación de publicidad descrita, en la WEB de la Consejería de Economía, Hacienda y Seguridad, en la Carta de Servicios de la Intervención General.

Además, la citada Ley Orgánica 9/2013, contempla medidas que unilateralmente cada Administración debe aplicar cuando detecte periodos medios de pago que superen los límites permitidos, así como medidas preventivas, correctivas y coercitivas que el Ministerio de Hacienda y Administraciones Públicas aplicará en su caso.

Con el fin de asegurar el cumplimiento de este mandato legal, el Gobierno de Canarias, mediante Acuerdo de 20 de febrero de 2014, aprobó una serie de medidas para contribuir a la reducción del periodo medio de pago y garantizar el cumplimiento de la normativa de lucha contra la morosidad y de estabilidad y sostenibilidad financiera, de aplicación a todos los agentes integrantes del sector público autonómico, tengan o no la consideración de Administración Pública de acuerdo con la definición y delimitación del Sistema Europeo de Cuentas Nacionales y Regionales.

Entre las medidas aprobadas se establece la emisión con carácter mensual de un informe sobre los periodos medios de pago y pendientes de pago, al objeto de identificar los retrasos producidos respecto a los plazos legales de pago y el departamento, o ente afectado, o, en su caso, la Dirección General del Tesoro y Política Financiera.

FÓRMULA PARA EL CÁLCULO DEL PERODO MEDIO DE PAGO (PMP).

La fórmula para el cálculo del PMP del ejercicio 2013, aplicada para determinar este ratio, fue la siguiente:

$$\text{Ratio de las operaciones pagadas} = \frac{\sum(\text{N}^{\circ} \text{ días de pago} \times \text{importe de la operación})}{\sum \text{Importe total de las operaciones}}$$

$$\text{Ratio de operaciones pendientes de pago} = \frac{\sum(\text{N}^{\circ} \text{ días pendientes de pago} \times \text{importe de la operación})}{\sum \text{Importe total de las operaciones}}$$

Mediante el Real Decreto 635/2014 de 25 de julio, por el que se desarrolla la metodología de cálculo del periodo medio de pago a proveedores de las Administraciones Públicas y las condiciones y el procedimiento de retención de recursos de los regímenes de financiación, previstos en la Ley Orgánica 2/2012, de 27 de abril, de Estabilidad Presupuestaria y Sostenibilidad Financiera, se estableció el método vigente para el cálculo del PMP de cada entidad. La modificación consistió en incorporar a la fórmula inicial el ratio de las operaciones pendientes de pago.

$$\text{Periodo medio de pago de cada entidad} = \frac{((\text{ratio de operaciones pagadas} \times \text{importe total de pagos realizados}) + (\text{ratio de operaciones pendientes de pago} \times \text{importe total de pagos pendientes}))}{\text{Importe total de pagos} + \text{importe total pendiente de pago}}$$

Como puede observarse en las fórmulas expuestas, la variable del importe unitario de las facturas incide de manera decisiva en la determinación de los ratios. La ponderación por los importes invita a los gestores de la tesorería de cada administración a priorizar el pago de las facturas de importe elevado, en perjuicio de las de importes pequeños. Ello puede conducir a situaciones injustas. Si en un momento determinado la tesorería de la entidad tiene una disponibilidad de fondos de un millón de Euros, para hacer frente a 31 facturas, de las cuales una tiene un importe de un millón, y el resto de cuantías inferiores, se obtendrá la mejor puntuación del ratio pagando ésta única factura en detrimento de las demás. Por tanto, solo un acreedor verá abonada su deuda en contra de 30 empresas que quedarían pendientes de pago.

Se trata de una consecuencia derivada de la normativa estatal reguladora del método de cálculo del ratio del periodo medio de pago, que influye de manera determinante en los criterios de ordenación de los pagos de las administraciones públicas.

También ha de resaltarse, que la modificación de la fórmula aprobada por el RD 635/2014 ha ponderado algo la desviación de la fórmula inicial, al considerar las facturas pendientes de pago, aunque la ponderación por importes sigue vigente y propicia que se atiendan prioritariamente las facturas de importes máximos.

2.3.2. El registro de facturas.

Para garantizar la integridad de los sistemas de recopilación y tratamiento de datos de las facturas y justificantes de pago, y la transparencia, de forma que se obtenga información suficiente y adecuada que permita verificar la situación financiera de la Comunidad Autónoma, el cumplimiento de los objetivos de estabilidad presupuestaria y de sostenibilidad financiera y la observancia de los requerimientos normativos en esta materia, el Gobierno de Canarias aprobó el Decreto 2/2014, de 23 de enero, por el que se crea y regula el Registro de Facturas del sector público autonómico de Canarias con presupuesto limitativo.

El propósito principal del Decreto es la creación de un Registro único y de acceso centralizado de las facturas, que deban satisfacer los órganos y entidades que integran el sector público con presupuesto limitativo de la Comunidad Autónoma de Canarias y que permita conocer de manera inmediata el volumen total de las obligaciones pendientes de ser liquidadas, con información de los órganos gestores, proveedores afectados y objetos de la prestación comprometida.

Sobre la base de este registro, la Intervención General de la CAC calcula el periodo medio de pago de las distintas entidades que componen el sector público con presupuesto limitativo.

Además de rendir la información que la Administración del Estado exige, con periodicidad mensual, se realiza un seguimiento pormenorizado de las unidades gestoras que tienen retrasos significativos en el pago de sus facturas. Mensualmente se elabora un informe, detallado por centros gestores, sobre el grado de cumplimiento de los ratios del periodo medio de pago y se identifican retrasos en los pagos; anualmente, se eleva este informe al Consejo de Gobierno. A la vista del mismo, el Gobierno de Canarias aprueba un Acuerdo por el que se establecen medidas de lucha contra la morosidad en las operaciones comerciales.

Según se establece por el artículo 216.4 del Real Decreto Legislativo 3/2011, de 14 de noviembre, por el que se aprueba la Ley de Contratos del Sector Público, “ *La Administración tendrá la obligación de abonar el precio dentro de los treinta días siguientes a la fecha de aprobación de las certificaciones de obra o de los documentos que acrediten la conformidad con lo dispuesto en el contrato de los bienes entregados o servicios prestados, sin perjuicio de lo establecido en el artículo 222.4, y si se demorase, deberá abonar al contratista, a partir del cumplimiento de dicho plazo de treinta días los*

intereses de demora y la indemnización por los costes de cobro en los términos previstos en la Ley 3/2004, de 29 de diciembre, por la que se establecen medidas de lucha contra la morosidad en las operaciones comerciales. Para que haya lugar al inicio del cómputo de plazo para el devengo de intereses, el contratista deberá de haber cumplido la obligación de presentar la factura ante el registro administrativo correspondiente, en tiempo y forma, en el plazo de treinta días desde la fecha de entrega efectiva de las mercancías o la prestación del servicio.” La gestión descrita va orientada a evitar que se produzcan estos intereses de demora, que reducirían los recursos disponibles para atender otras necesidades públicas.

2.3.3. Tabla evolución método de cálculo del periodo medio de pago

La ley 3/2004, de 29 de diciembre, por la que se establecen medidas de lucha contra la morosidad en las operaciones comerciales, y cuyo objeto consiste en *“combatir la morosidad en el pago de las deudas dinerarias y el abuso, en perjuicio del acreedor, en la fijación de los plazos de pago en las operaciones comerciales que den lugar a la entrega de bienes o en la prestación de servicios realizadas entre empresas o entre empresas y la Administración”*, ha sufrido en su artículo 4 relativo a la determinación del plazo de pago diversas modificaciones por sucesivas disposiciones legislativas en el apartado relativo a las operaciones que puedan mediar entre las empresas y la Administración y en las que resulta preceptiva legalmente la aceptación y conformidad en la entrega de bienes o la prestación de servicios.

En una primera redacción la Ley 3/2004, establecía como límite del plazo de pago por la Administración treinta días después de la aceptación o verificación (art.4.1-d), tras la modificación efectuada por la Ley 15/2010, de 5 de julio, este plazo se establece en sesenta días desde la fecha de entrega de la mercancía o prestación del servicio (ar.4.1.c).

A partir del 24 de febrero de 2013, en virtud de la modificación efectuada a la Ley 3/2004 por el Real Decreto Ley 4/2013, de 22 de febrero, de medidas de apoyo al emprendedor y de estímulo del crecimiento y de la creación de empleo, se establece un plazo máximo para realizar la aceptación o conformidad (de los bienes o servicios) de treinta días naturales desde la fecha de recepción o prestación de los mismos y un plazo de pago de treinta días después de la fecha en que tiene lugar la aceptación o verificación de los bienes o servicios, incluso aunque la factura o solicitud de pago se hubiera recibido con anterioridad a la aceptación o verificación (art.4.2). Con el objeto de adecuar la normativa de contratación administrativa a este criterio este Real Decreto Ley modifica el apartado 4 del artículo 216 del Texto Refundido de la Ley de Contratos del Sector Público en idéntico sentido: *“La Administración tendrá la obligación de abonar el precio dentro de los treinta días siguientes a la fecha de aprobación de las certificaciones de obra o de los documentos que acrediten la conformidad con lo*

dispuesto en el contrato de los bienes entregados o servicios prestados, sin perjuicio de lo establecido en el art. 222.4, y si se demorase, deberá abonar al contratista, a partir del cumplimiento de dicho plazo de treinta días los intereses de demora y la indemnización por los costes de cobro en los términos previstos en la Ley 3/2004, de 29 de diciembre, por la que se establecen medidas de lucha contra la morosidad en las operaciones comerciales. Para que haya lugar al inicio del cómputo de plazo para el devengo de intereses, el contratista deberá de haber cumplido la obligación de presentar la factura ante el registro administrativo correspondiente, en tiempo y forma, en el plazo de treinta días desde la fecha de entrega efectiva de las mercancías o la prestación del servicio.”

Este criterio se mantiene en la Ley 11/2013, de 24 de julio, de medidas de apoyo al emprendedor y de estímulo del crecimiento y de la creación de empleo.

2.3.4 Comparación datos PMP años 2013-2014.

La IGCAC informa periódicamente al Gobierno de Canarias acerca de los periodos medios de pago de cada una de las entidades que integran el sector público canario. Sobre la base de estos informes se adoptan medidas para asegurar el cumplimiento de los plazos de pago que la normativa vigente establece. Ha de resaltarse que aunque el cálculo del PMP solo computa los tiempos desde la conformidad de la factura hasta el pago, la IGCAC en sus informes también ofrece información sobre los tiempos que se tarda en conformar una factura, lo cual redundará en propiciar mayor eficacia en la gestión de los expedientes de gasto.

El cuadro siguiente refleja la evolución de los ratios de pago desde 2013 a 2014. Ha de señalarse, tal como se comentó en el apartado anterior, que la metodología de cálculo del PMP ha variado desde 2013 al 2014.

CUADRO EVOLUCION PERIODO MEDIO DE PAGO (PMP) 2013/2014.						
ENTIDAD/ AÑO	S.C.S.		CAC-OOAA (SIN SCS)		TOTAL CAC	
	2013	2014	2013	2014	2013	2014
Nº DE OPERACIONES	208.352	267.396	25.079	28.422	233.431	295.818
IMPORTE PAGOS. (miles €)	1.142.992,91	1.264.401,50	456.552,05	563.727,50	1.599.544,96	1.828.129,00
PROMEDIO Nº DIAS CONFORMIDAD-PAGO	55,92	57,43	71,71	27,06	60.43(*)	48,06(*)

(*) Se ha calculado sumando el resultado de multiplicar el importe total de pago de cada entidad por su PMP, y dividirlo por la suma de los pagos de las dos entidades.

En el transcurso de la fiscalización se realizó una prueba de auditoría consistente en seleccionar una muestra de las facturas abonadas, comprobando la consistencia de las fechas utilizadas para calcular los PMP con las fechas reales del sistema SEFCAN, resultando plenamente satisfactoria las comprobaciones realizadas.

2.4. Anticipos de tesorería a empresas.

Los anticipos de tesorería a entes integrantes del sector público autonómico, por plazo no superior a un año, están regulados por el artículo 87.1 de la Ley 11/2006, de 11 de diciembre, de la Hacienda Pública de Canarias.

RELACIÓN DE ANTICIPOS DE TESORERÍA (2011-2014)					
	HECANSA	GRAFCAN	GESPLAN	GESTUR TENERIFE	TOTAL
2011	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
2012	1.200.000,00	0,00	0,00	0,00	1.200.000,00
2013	0,00	1.031.282,35	3.072.848,00	0,00	4.104.130,35
2014	0,00	2.056.500,00	3.074.131,00	30.000,00	5.160.631,00
TOTALES	1.200.000,00	3.087.782,35	6.146.979,00	30.000,00	10.464.761,35

Según se deduce de los registros contables, se ha comprobado que todos los anticipos han sido cancelados antes de finalizar el año desde su concesión, tal como regula la normativa vigente.

La operatoria contable del SEFCAN, en lo concerniente a la elaboración de los mayores de la cuenta 4490010041 "Anticipos de tesorería a empresas", y en general de todos los conceptos extrapresupuestarios, es muy compleja. En los mayores se registran muchas operaciones de formalización, sin que se entienda fácilmente el origen o la causa de esos asientos. Ello hace muy laboriosa la tarea de identificar los pagos y las cancelaciones de los anticipos en cuestión. Resulta especialmente complejo determinar la composición del saldo deudor que arroja la cuenta en cualquier momento del ejercicio. El sistema carece de una utilidad para detallar la composición de un saldo deudor. Esto se debe gestionar mediante procesos extracontables.

La evolución de estos anticipos en el periodo fiscalizado ha sido la siguiente:

Cuenta 4490010041 ANTICIPOS TESORERIA ART. 87 LEY 11/2006					
	SALDO 1-1	TOTAL DEBE	TOTAL HABER	SALDO DEUDOR	SALDO ACREEDOR
2011	3.412.149,85	0	3.412.149,85	0	0
2012	0	1.200.000,00	1.200.000,00	0	0

2013	0	4.104.130,35	347.730,00	3.756.400,35	0
2014	3.756.400,35	5.160.631,00	8.824.169,64	92.861,71	0

2.5. Presupuestos de tesorería, liquidez y endeudamiento.

El Presupuesto de Tesorería es el instrumento principal para la planificación de la tesorería. El Plan de Tesorería y la Posición de Tesorería están vinculados a través de una serie de reglas de gestión de las diferencias, que permiten actualizar el Plan de Tesorería con la evolución del materializado de tesorería y, al mismo tiempo, trasladar a la Posición de Tesorería las previsiones de los próximos meses establecidas en el Plan de Tesorería. Es decir, ambos instrumentos están vinculados.

Estas herramientas son decisivas para determinar el montante de las necesidades de financiación ajena en cada momento, a fin de definir un óptimo de liquidez, al tiempo que permita cumplir con los ratios de pago a los proveedores en plazo.

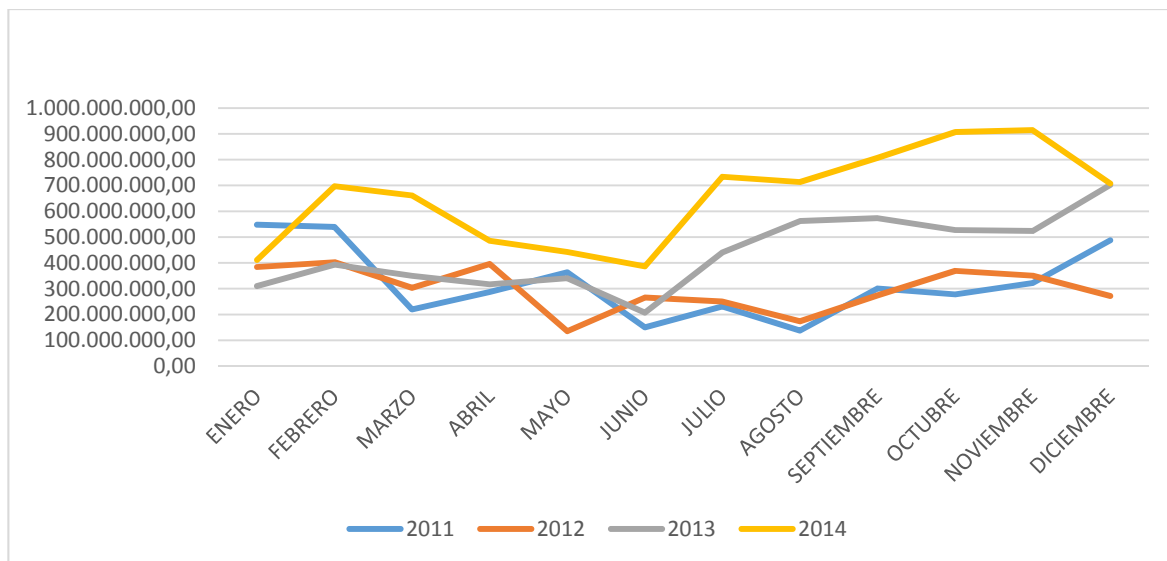
A continuación se refleja la evolución real de los saldos mensuales de la tesorería en el periodo analizado (2011-2014):

EVOLUCIÓN MENSUAL DE LAS EXISTENCIAS S/ PRESUPUESTOS DE TESORERIA. (EN EUROS)				
	2011	2012	2013	2014
ENERO	547.963.048,36	383.947.478,90	310.489.714,08	411.254.435,57
FEBRERO	539.199.891,15	402.555.365,27	393.226.136,28	697.284.036,23
MARZO	219.905.155,12	303.537.088,36	349.622.888,06	661.047.876,68
ABRIL	286.995.214,74	395.685.851,29	316.954.600,75	485.796.042,39
MAYO	363.396.247,28	135.602.629,18	340.772.576,05	442.356.350,34
JUNIO	149.931.608,28	265.710.023,19	207.307.564,31	386.411.672,81
JULIO	231.499.501,22	249.783.618,72	440.539.338,19	733.611.669,70
AGOSTO	137.674.777,64	173.700.680,54	561.843.245,27	713.422.963,90
SEPTIEMBRE	300.772.563,04	274.305.613,35	572.997.603,05	807.214.441,29
OCTUBRE	278.017.390,23	369.375.790,54	527.495.395,64	906.525.897,35
NOVIEMBRE	321.708.032,75	350.756.795,78	523.829.442,31	914.446.967,93
DICIEMBRE	487.792.302,92	271.663.927,34	702.300.703,27	707.977.876,84

Elaboración propia.

Fuente: DG del Tesoro y Política Financiera.

A continuación, se presenta un gráfico que muestra la citada evolución de los saldos mensuales de tesorería.



Analizando el presupuesto de tesorería aquí comentado, se observa que a partir del mes de mayo de 2014 (442 millones de Euros), las existencias fueron aumentando paulatinamente, hasta alcanzar un monto de 914 millones de Euros en el mes de noviembre, resultando unas existencias finales al cierre del ejercicio de 708 millones de Euros.

Aun siendo cierto que la deuda pública es un recurso para equilibrar las dotaciones iniciales del presupuesto de ingresos y gastos, ésta solo debe materializarse cuando las necesidades de tesorería así lo exigen.

Por el lado del endeudamiento, podemos señalar que en el periodo analizado (2011-2014), la deuda viva de la CAC ha aumentado un total de 2.507 millones de Euros. En el cuadro siguiente se observa la evolución de estos cuatro años.

	2011	2012	2013	2014	
DEUDA VIVA 1/1 (A)	3.473.965.787	3.694.377.073	4.473.408.755	5.171.604.254	
FORMALIZACIONES	496.882.238	1.466.229.553	1.079.813.812	1.733.032.673	
AMORTIZACIONES	264.450.801	687.065.671	381.618.313	923.009.690	
DEUDA VIVA 31/12 (B)	3.694.377.073	4.473.540.956	5.171.604.254	5.981.627.237	
B-A	220.411.286	779.163.883	698.195.499	810.022.983	2.507.793.651
Fuente Memoria Cta. Gral. CAC. Nota: estos datos no cuadran en origen. Elaboración propia.					

Se produce una cierta correlación entre la variación neta de la deuda viva de cada año y las existencias finales de la tesorería. El incremento de la deuda aumenta el volumen final de las existencias.

Analizados los distintos presupuestos de tesorería y sus desviaciones, durante el periodo 2011 a 2014, se observa que el menor saldo de liquidez presentado, es el del mes de mayo de 2012 por un importe aproximado de 135 millones de euros. Salvo que ese sea el importe mínimo necesario de funcionamiento de la Comunidad, podría haberse disminuido el endeudamiento con el consecuente ahorro de intereses.

Así mismo, se observa que en diferentes meses de los distintos periodos los saldos de tesorería han llegado a superar con creces la cifra anteriormente expresada por lo que podría haberse retrasado en el tiempo el endeudamiento, lo cual ahorraría una cantidad importante en intereses. Ello evidencia la conveniencia de reducir el recurso a la financiación ajena, lo cual repercutiría favorablemente en la reducción de los pasivos y gastos financieros de la CAC.

Se ha identificado un supuesto concreto de ineficiencia en la gestión del endeudamiento, representado por la póliza de crédito por importe de 100 millones de Euros, suscrita 29 de mayo de 2014, con la entidad financiera CaixaBank S.A., de la cual no se dispuso un solo Euro, y por la que hubo de abonarse 413.332,89 €, en concepto de comisión de no disponibilidad.

COMISION NO DISPONIBILIDAD POLIZA CAIXA BANK 29.5.14	
FECHA VENCIMIENTO	IMPORTE
30.11.2014	202.222,22
31.08.2014	204.444,00
31.05.2014	6.666,67
	413.332,89

2.6. Análisis financiero de la financiación ajena.

2.6.1 Préstamos.

Se ha analizado el coste financiero de la financiación ajena obtenida en el periodo 2011-2014, tanto para la Deuda Pública como para los préstamos concertados. El tipo de interés pactado se ha comparado con la media de las emisiones en el año, tanto en el mercado español como en el europeo. Los tipos de referencia se han obtenido de la agencia de evaluación Bloomberg. Para ello se ha calculado la media aritmética de los tipos para los préstamos. Las medias obtenidas son las siguientes:

PRESTAMOS	2011	2012	2013	2014
ESPAÑA	4,9185	6,336	3,340	4,60
EUROPA	4,131	4,562	3,873	4,20

Fuente: BLOOMBERG.

BANCA CIVICA						
	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
LINEA DE CREDITO		05/03/2012	50.000.000,00	3,681%	4,918%	4,131%
PTMO.ICO	Financiación de las inversiones de los presupuestos ejerc.2.011 se ingresa en la BANCA CIVICA. 2 años de carencia vto.29.12.2013 8 años de amortización – 8 cuotas anuales del 29.12.2014 al 29.12.2021	29/12/2021	100.000.000,00	5,184%	4,918%	4,131%

Se ha comprobado que el tipo aplicado por la entidad bancaria, para el préstamo ICO, es mayor que la media aritmética de los tipos de los mercados español y europeo de esos años”.

BANCA MARCH					
FECHA	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
2013	25/03/2015	5.000.000,00	3,54%	3,34%	3,873%
2012	01/03/2026	11.048.483,41	3,317%	6,336%	4,562%

Se observa que el tipo aplicado está por debajo de la media aritmética de los tipos del mercado europeo de 2013 y por encima del español de 2013, en el primer caso.

En el segundo caso, se observa que el tipo aplicado está por debajo de la media aritmética de los tipos de los mercados español y europeo de 2012.

BANCO CAM PRESTAMO ICO						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
11.06.2012	FONDO FINANCIACION PAGO A PROVEEDORES	26/06/2022	10.235.476,97	5,912%	6,3360%	4,5620%

Se observa que el tipo aplicado es superior a la media aritmética de los tipos del mercado europeo

BANCO POPULAR PRESTAMO ICO						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
21/06/2012	FONDO FINANCIACION DE LOS PAGOS A PROVEEDORES	26/06/2022	23.947.546,80	5,912%	6,3360%	4,5620%

Se observa que el tipo aplicado es superior a la media aritmética de los tipos del mercado europeo

BANCO SABADELL						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
30/12/2011	PRESTAMO	30/12/2018	10.000.000,00	5,3700%	4,9185%	4,1310%
26/6/2012	FONDO FINANCIACION PAGOS A PROVEEDORES. PTMO.ICO	26/06/2022	11.257.868,15	5,9120%	6,3360%	4,5620%
1/8/2013	PRESTAMO	01/08/2017	10.000.000,00	4,6100%	3,3400%	3,8730%

Se observa que el tipo aplicado es superior a la media aritmética de los tipos del mercado europeo, y al tipo español en los dos casos.

BANESTO PRESTAMO ICO						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
21/06/2012	FONDO FINANCIACION PAGOS A PROVEEDORES	21/06/2022	13.304.963,72	5,9120%	6,3360%	4,5620%

Se observa que el tipo aplicado es superior a la media aritmética de los tipos del mercado europeo.

BANKIA PRESTAMO ICO				
FECHA	IMPORTE	APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
21/06/2012	31.377.720,60	5,9120%	6'336%	4,5620%

Se observa que el tipo aplicado es superior a la media aritmética de los tipos del mercado europeo.

BANKINTER						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
01/09/2011	LINEA DE CREDITO	01/03/2012	25.000.000,00	3,196%	4,9185%	4,131%
21.06.2012	PTMO.ICO. Pago a proveedores	26/06/2022	10.235.477,26	5,912%	6,336%	4,562%

Se observa en el préstamo ICO que el tipo aplicado es superior a la media aritmética de los tipos del mercado europeo.

BBVA						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
30/12/2011	PRESTAMO DEAL (BBVA-BANCA CIVICA)	30/12/2017	40.000.000,00	6,294%	4,9185%	4,131%
17/01/2011	SUBR HIPOTECA DEPOSITOS Nº1	31/07/2022	4.982.237,60	2,776%	3,3720%	4,131%
17/01/2011	SUBR HIPOTECA DEPOSITOS Nº1 ROSA DELIA	31/07/2022	4.982.237,60	2,776%	3,3720%	4,131%
21/06/2012	PRESTAMO ICO	21/06/2022	31.391.109,97	5,912%	6,336%	4,562%
31/03/2012	SUBROGACION HIPOTECA EDIFICIO	30/04/2020	21.642.992,32	3,700%	3,416%	4,562%
28/05/2013	PRESTAMO DEAL (BBVA-BSCH-CAIXABANK)	27/05/2017	38.821.400,00	4,656%	3,340%	3,873%
17/11/2014	PRESTAMO	17/11/2024	112.000.000,00	1,119%	4,600%	4,200%
11/12/2014	PRESTAMO DEAL (BBVA-BSCH-CAIXABANK)	11/12/2024	85.206.876,00	1,229%	4,600%	4,200%

Se observa que el primer y sexto préstamo tienen un tipo aplicado superior a la media aritmética de los tipos del mercado español y europeo.

PRESTAMO ICO CAJASIECAJARURAL						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
21/06/2012	FONDO PARA FINANCIACION PAGOS A PROVEEDORES	21/06/2022	10.235.479,42	5,912%	6,3360%	4,5620%

Se observa que el tipo aplicado es superior a la media aritmética de los tipos del mercado europeo.

ICO (FFPP)						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
20/11/2013	PRESTAMO PAGO A PROVEEDORES	20/11/2023	24.357.107,58	3,34%	3,34%	3,873%
13/02/2014	PRESTAMO PAGO A PROVEEDORES	13/02/2024	59.384.316,28	3,34%	4,60%	4,20%

Se observa que los tipos aplicados están por debajo de la media aritmética de los mercados español y europeo.

ICO FONDO LIQUIDEZ ANUAL (FLA)						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
26/12/2012	CONTRATO FLA	26/12/2023	907.257.649,99	1%	6,336%	4,562%
27/12/2013	CONTRATO FLA	27/12/2024	842.259.128,26	1%	3,340%	3,873%
19/12/2014	CONTRATO FLA	19/12/2025	829.080.000,00	1%	4,600%	4,200%

Se observa que los tipos aplicados están muy por debajo de la media aritmética de los mercados español y europeo.

CAIXABANK						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑOL	TIPO MEDIO EUROPEO
09/09/2011	CREDITO TIPO VARIABLE	09/03/2013	15.000.000,00	4,076%	4,919%	4,131%
31/03/2013	UNIFICACIÓN DE TRES CRÉDITOS TIPO FIJO	28/02/2014	45.000.000,00	3,540%	3,340%	3,873%
29/05/2014	CUENTA DE CRÉDITO TIPO VARIABLE	29/05/2015	100.000.000,00	1,826%	4,600%	4,200%
11/12/2014	PRESTAMO DEAL (CAIXABANK, BBVA, SANTANDER)	10/12/2024	35.586.248,00	1,229%	4,600%	4,200%
05/11/2014	PRESTAMO TIPO VARIABLE	04/11/2024	112.000.000,00	1,199%	4,600%	4,200%
26/06/2012	PRESTAMO ICO TIPO VARIABLE		31.391.110,00	5,912%	6,336%	4,562%

Se observa lo siguiente:

- Que en el año 2011, el tipo de interés aplicado por la entidad bancaria, en un crédito a tipo variable, ha sido inferior de la media aritmética de los mercados español y europeo.
- Que en el año 2012, en el préstamo ICO con tipo variable, el interés aplicado por la entidad bancaria ha sido menor que media aritmética del mercado español, y a su vez, ha sido mayor que la media aritmética del mercado europeo.
- Que en el año 2013, el tipo de interés aplicado por la entidad bancaria en una serie de créditos a tipo fijo, ha sido mayor que la media aritmética del mercado español, pero inferior la media aritmética del mercado europeo.
- Que en el año 2014, el tipo de interés aplicado por la entidad bancaria ha sido inferior la que la media aritmética del mercado español y europeo.

NOVAGALICIA. PRESTAMO ICO						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO ESPAÑA	TIPO EUROPEO
30/04/2012	FONDO PARA FINANCIACION DE LOS PAGOS A PROVEEDORES	29/05/2022	26.528.969,01	5,9120%	6,3360%	4,5620%

Se observa que el tipo aplicado es superior a la media aritmética del mercado europeo.

BANCO SANTANDER						
FECHA	CONCEPTO	VENCIMIENTO	IMPORTE	TIPO APLICADO	TIPO MEDIO ESPAÑOL	TIPO MEDIO EUROPEO
05/07/2012	PRESTAMO A TIPO FIJO	05/07/2017*	38.821.000,00	6,840%	6,336%	4,562%
08/06/2012	PRESTAMO A TIPO FIJO	08/06/2016	150.000.000,00	5,980%	6,336%	5,562%
21/06/2013	PRESTAMO A TIPO FIJO	21/06/2018	100.000.000,00	4,750%	3,340%	3,873%
11/12/2014	PRESTAMO DEAL (SANTANDER, CAIXA, BBVA)	11/12/2024	85.206.876,00	1,229%	4,600%	4,200%
01/07/2014	PRESTAMO A TIPO FIJO	01/07/2016	100.000.000,00	1,687%	4,600%	4,200%
01/07/2014	PRESTAMO TIPO FIJO	01/07/2024	100.000.000,00	2,167%	4,600%	4,200%
21/06/2012	PRESTAMO ICO TIPO VARIABLE (EURIBOR MAS DIFERENCIAL)		31.391.109,91	5,912%	6,336%	4,562%

* Este préstamo fue amortizado, anticipadamente, el 27/11/2014

Se observa que los tipos aplicados están por encima de la media aritmética del mercado europeo, salvo en el año 2014, que están muy por debajo de la media aritmética del mercado español y europeo.

2.6.2 Deuda pública.

Los tipos de referencia se han obtenido de la agencia de evaluación Bloomberg. Para ello se ha calculado la media aritmética de los tipos de las emisiones de bonos y deuda pública del año, tanto en el mercado español como en el europeo.

RESUMEN TIPO MEDIO DEUDA Y BONOS				
	2011	2012	2013	2014
EUROPA	2,839%	2,372%	2,084%	1,602%
ESPAÑA	5,035%	4,583%	4,206%	2,923%

Fuente: Bloomberg.

Al comparar estos tipos medios de referencia con los de las emisiones de deuda realizadas por el Tesoro se obtiene el siguiente cuadro.

DEUDA PUBLICA					
FECHA EMISION	VENCIMIENTO	IMPORTE SUSCRITO	TIPO INTERES	TIPO MEDIO ESPAÑA	TIPO MEDIO EUROPEO
20/09/2011	20/09/2016	200.000.000	2%	5,035%	2,839%
20/12/2011	20/12/2016	16.900.000	2%	5,035%	2,839%
28/11/2012	28/11/2017	51.305.000	2%	4,583%	2,372%
02/12/2013	02/12/2018	75.000.000	1,75%	4,206%	2,084%
15/12/2014	15/12/2019	50.000.000	0,50%	2,923%	1,602%

Se observa que los tipos de todas las emisiones de deuda del Gobierno de Canarias han sido más bajos que las medias españolas y europeas.

Se observa que el importante ahorro en intereses, respecto a las emisiones comparadas, se debe fundamentalmente a las ventajas fiscales que proporcionaba esa deuda, al poder ser aplicada para la materialización del 50% de la dotación para la Reserva de Inversión en Canarias (RIC).

2.7. Rendimiento obtenido por la bonificación en el pago de las retenciones del IRPF.

La Dirección General del Tesoro ha realizado diversas convocatorias a las entidades financieras, para que ofertaran una bonificación por el pago del IRPF. Así para los meses enero, febrero y marzo del año 2011, la mejor oferta planteada fue la de CAJA SIETE, que ofreció el 0,0430% sobre el nominal de la cesión.

Analizado el cuadro de liquidación de acuerdo con la oferta realizada, se observa que se ajusta a lo pactado, recibiendo la Dirección General del Tesoro, la cantidad de 26.162,64€ por este trimestre.

En el segundo trimestre la mejor oferta fue la de SA NOSTRA, que ofertó 0,0688, analizado el cuadro de liquidación se ajusta a la oferta planteada, percibiendo la Dirección General 33.535,98 € por este concepto y trimestre.

En el tercer y cuatro trimestres se adjudica a la mejor oferta y las liquidaciones a las que se ha tenido acceso son acordes con las condiciones pactadas.

Analizados los ejercicios 2012, 2013 y 2014, se observa que la Dirección General ha adjudicado el pago del IRPF a través de las entidades que ofrecen las mejores condiciones recibidas, y que las liquidaciones practicadas han sido acordes con las condiciones pactadas.

INGRESOS POR BONIFICACION IRPF EJERCICIO 2011				
MES	ENTIDAD	IMPORTE	TIPO	INGRESO
ENERO	CAJA SIETE	28.264.046,53	0,043	12.153,54
FEBRERO	CAJA SIETE	16.435.193,06	0,043	7.067,13
MARZO	CAJA SIETE	16.144.115,42	0,043	6.941,97
ABRIL	SA NOSTRA	16.289.399,38	0,0688	11.207,11
MAYO	SA NOSTRA	16.236.991,28	0,0688	11.171,05
JUNIO	SA NOSTRA	16.217.760,31	0,0688	11.157,82
JULIO	CAJA RURAL DE CANARIAS	28.214.066,23	0,0610	17.210,58
AGOSTO	CAJA RURAL DE CANARIAS	15.841.325,88	0,0610	9.663,21
SEPTIEMBRE	CAJA RURAL DE CANARIAS	15.919.738,65	0,0610	9.711,04
OCTUBRE	CAJA SIETE	15.827.654,98	0,065	10.287,98
NOVIEMBRE	CAJA SIETE	16.249.626,76	0,065	10.562,26
DICIEMBRE	CAJA SIETE	17.831.180,37	0,065	11.590,27
		TOTAL GENERAL		128.723,95

INGRESOS POR BONIFICACION IRPF EJERCICIO 2012				
MES	ENTIDAD	IMPORTE	TIPO	INGRESO
ENERO	CAJA RURAL DE CANARIAS	28.625.408,23	0,066	18.892,77
FEBRERO	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.538.835,18	0,066	10.915,63
MARZO	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.728.483,97	0,066	11.040,80
ABRIL	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.882.090,14	0,0673	11.361,65
MAYO	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.646.053,48	0,0673	11.202,79
JUNIO	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.841.538,75	0,0673	11.334,36
JULIO	CAJA RURAL DE CANARIAS	29.356.670,68	0,0675	19.815,75
AGOSTO*	CAJA RURAL DE CANARIAS	NOTA *		
SEPTIEMBRE*	CAJA RURAL DE CANARIAS	29.963.093,34	0,0675	20.225,09
OCTUBRE	CAJA SIETE	15.203.454,36	0,0706	10.733,64
NOVIEMBRE	CAJA SIETE	15.769.502,51	0,0706	11.133,27
DICIEMBRE	CAJA SIETE	15.825.290,22	0,0706	11.172,65
		TOTAL GENERAL		147.828,40

(*) La liquidación de agosto se acumuló a la de septiembre.

INGRESOS POR BONIFICACION IRPF EJERCICIO 2013				
MES	ENTIDAD	IMPORTE	TIPO	INGRESO
ENERO	SA NOSTRA	19.251.011,31	0,0720	13.860,73
FEBRERO	SA NOSTRA	16.105.058,51	0,0720	11.595,64
MARZO	SA NOSTRA	16.069.873,50	0,0720	11.570,31
ABRIL	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.060.640,67	0,0510	8.190,93
MAYO	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.155.652,27	0,0510	8.239,38
JUNIO	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.441.651,20	0,0510	8.385,24
JULIO	CAJA RURAL DE CANARIAS	28.221.300,85	0,0470	13.264,01
AGOSTO	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.079.242,76	0,0470	7.557,24
SEPTIEMBRE	CAJA RURAL DE CANARIAS	15.970.162,89	0,0470	7.505,98
OCTUBRE	CAJA RURAL DE CANARIAS	16.395.862,94	0,0470	7.706,06
NOVIEMBRE	CAJA RURAL DE CANARIAS	17.290.034,14	0,0470	8.126,32
DICIEMBRE	CAJA RURAL DE CANARIAS	18.613.208,14	0,0470	8.748,21
		TOTAL GENERAL		114.750,04

INGRESOS POR BONIFICACION IRPF EJERCICIO 2014				
MES	ENTIDAD	IMPORTE	TIPO	INGRESO
ENERO	BANCO SANTANDER	27.882.521,24	0,0350	9.758,88
FEBRERO	BANCO SANTANDER	16.218.700,91	0,0350	5.676,55
MARZO	BANCO SANTANDER	16.241.811,94	0,0350	5.684,63
ABRIL	BANCO SANTANDER	16.238.867,00	0,0350	5.683,60
MAYO	BANCO SANTANDER	18.303.532,72	0,0350	6.406,24
JUNIO	BANCO SANTANDER	16.317.623,58	0,0350	5.711,17
JULIO	BANCO SANTANDER	28.761.282,11	0,0350	10.066,45
AGOSTO	BANCO SANTANDER	16.098.580,70	0,0350	5.634,50
SEPTIEMBRE	BANCO SANTANDER	16.219.707,00	0,0350	5.676,90
OCTUBRE	BANCO SABADELL	16.575.329,54	0,0250	4.143,83
NOVIEMBRE	BANCO SABADELL	17.233.675,48	0,0180	3.102,06
DICIEMBRE	BANCO SABADELL	18.682.489,19	0,0200	3.736,50
		TOTAL GENERAL		71.281,31

RESUMEN TOTAL	2011	2012	2013	2014	TOTAL PERIODO
	128.723,95	147.828,40	114.750,04	71.281,31	462.583,70

2.8. Análisis del rendimiento de los depósitos y cuentas corrientes operativas.

El trabajo desarrollado ha consistido en comparar el rendimiento obtenido por la Tesorería de la CAC, derivado de los saldos medios de las distintas cuentas y depósitos (16 Bancos; 29 cuentas), que aunque no son la totalidad de las cuentas del ESF de la Administración de la CAC, representan más del 70% de la población, para los cuatro años del ámbito temporal de la fiscalización.

Para abordar el análisis de este apartado se han analizado pormenorizadamente los extractos bancarios de las distintas cuentas corrientes abiertas en las diversas entidades financieras de las que disponíamos de extractos completos. El objetivo del trabajo ha consistido en revisar las liquidaciones de intereses practicadas por las distintas entidades bancarias, su cotejo con los tipos que debían ser aplicados, en base a los contratos firmados, para el periodo de tiempo objeto de esta fiscalización.

A continuación se expone el cuadro de los distintos convenios firmados sobre los que se ha realizado el trabajo y donde se estipula el tipo de interés que se aplica en las cuentas de la CAC por cada Entidad:

Entidad	Fecha del acuerdo	Tipo	Periodo de liquidación
BBVA	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
LA CAIXA	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
BANCO SANTANDER	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
CAJA INS DE AHORROS DE CANARIAS-BANKIA	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
CAJA MAR-CAJA RURAL DE CANARIAS	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
BANESTO	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
BANKINTER	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
CAJA MADRID	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
SANOISTRA-BANCO MARE NOSTRUM	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
CAJA SIETE-CAJA GENERAL DE	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
BANCA MARCH	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses	Trimestres naturales vencidos
BANCO PASTOR	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses +0,15	Trimestres naturales vencidos
BANCO SABADELL	27 de diciembre de 2007	Euribor tres meses +0,15	Trimestres naturales vencidos

Este tipo de interés se establece por los diversos convenios reguladores de la apertura de las cuentas, que estipulan lo siguiente:

“SEXTA.- Tipo de interés nominal remuneratorio mínimo.

1. El tipo de interés nominal remuneratorio de las cuentas corrientes será, como mínimo, el tipo de interés de referencia Euribor.
2. El tipo de interés de referencia Euribor, de acuerdo con lo previsto en el Código de Conducta aprobado por la Federación Bancaria Europea y por la Asociación Cambista Internacional, ser la media de los tipos de interés a que ofrezcan depósitos interbancarios denominados en euros para el plazo de tres meses dentro de la zona de la Unión Monetaria Europea, los bancos y cajas establecidos de acuerdo con el citado Código, calculado y publicado por Bridge Telerate a las 11:00 horas de Bruselas el segundo día hábil anterior al inicio del periodo de interés. Si el periodo de interés comenzara un día inhábil, se aplicará el Euribor a dichos plazos publicados y calculados a las 11:00 horas de Bruselas el tercer día hábil anterior al inicio del periodo de interés. Se considerarán días inhábiles los así establecidos en el citado Código.”

“CLAUSULA SEPTIMA.- Liquidación de intereses

Las liquidaciones de intereses se practicarán por trimestres naturales, estableciendo como la fecha del cierre de la liquidación el último día de dicho trimestre y aplicando a la liquidación de intereses resultante el tipo de interés establecido en la Cláusula Sexta, de la forma que se apliquen un solo tipo de interés en todo el periodo de liquidación.”

2011		
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%

2012		
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%

2013		
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%

2014		
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%

Tras el cálculo de los diferentes números comerciales y la aplicación de los tipos mínimos antes citados, se ha comparado el resultado con lo efectivamente ingresado por la Tesorería de la CAC en concepto de intereses, obteniendo diferencias positivas y negativas, aunque finalmente las diferencias positivas superan a las negativas. Ha de considerarse que en ocasiones se producen errores en la liquidación de intereses que son subsanados en un ingreso que se formaliza con posterioridad.

Los cálculos realizados y la correspondiente comparación se concretan en el siguiente cuadro:

RESUMEN COMPARACION DE INTERESES CALCULADOS/INTERESES INGRESADOS												
	2011			2012			2013			2014		
BANCO	(A) INTERESES CALCULADOS	(B) INTERESES INGRESADOS	B-A	(A) INTERESES CALCULADOS	(B) INTERESES INGRESADOS	B-A	(A) INTERESES CALCULADOS	(B) INTERESES INGRESADOS	B-A	(A) INTERESES CALCULADOS	(B) INTERESES INGRESADOS	B-A
B. PASTOR	236.367,32	235.472,13	-895,19	295.816,67	296.190,89	374,22	125.020,91	126.562,67	1.541,76	0,00	0,00	0,00
B. POPULAR	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00	38.763,36	38.763,36	0,00	362.246,25	361.748,01	-498,24
B. SABADELL	464.600,94	471.071,73	6.470,79	550.565,93	559.742,02	9.176,09	2.372.791,35	2.409.223,32	36.431,97	330.368,19	311.527,09	-18.841,10
B. SANTANDER	107.090,87	108.461,85	1.370,98	124.485,60	127.469,67	2.984,07	53.417,35	54.220,68	803,33	44.251,38	44.851,74	600,36
	81.891,72	81.783,70	-108,02	47.881,59	47.992,77	111,18	9.183,35	9.191,84	8,49	10.058,14	10.143,62	85,48
	27.041,05	26.995,35	-45,70	5.697,26	5.705,12	7,86	766,50	766,57	0,07	1.040,22	1.040,19	-0,03
	0,00	0,00	0,00	66.279,82	67.690,36	1.410,54	78.186,97	78.161,86	-25,11	63.488,16	63.273,04	-215,12
B. MARCH	510.571,12	511.148,83	577,71	225.465,82	225.932,90	467,08	173.365,39	172.184,36	-1.181,03	391.267,17	391.296,99	29,82
BANESTO	139.155,61	137.801,59	-1.354,02	53.410,30	54.257,14	846,84	25.590,46	25.641,03	50,57	15.317,25	15.287,14	-30,11
BANKIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4.963,62	4.977,55	13,93	3.151,32	3.151,31	-0,01
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	110.240,10	129.501,26	19.261,16	222.224,61	222.144,38	-80,23
BANKINTER	292.886,88	295.413,77	2.526,89	187.768,91	190.929,75	3.160,84	88.203,66	88.700,61	496,95	65.890,47	66.813,70	923,23
BBVA	133.820,82	133.812,45	-8,37	166.812,23	167.726,37	914,14	39.996,72	41.223,50	1.226,78	59.479,94	61.476,72	1.996,78
	99.574,34	95.865,37	-3.708,97	53.532,80	54.069,23	536,43	8.602,55	8.602,55	0,00	9.581,26	9.581,26	0,00
	12.126,35	12.110,88	-15,47	1.612,76	1.615,21	2,45	185,99	185,99	0,00	240,83	240,83	0,00

CAIXABAN	268.488,71	268.272,80	-215,91	152.993,41	154.306,35	1.312,94	29.244,99	27.187,85	-2.057,14	77.715,31	246.072,83	168.357,52
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.073,07	1.123,06	49,99	2.012,95	1.504,72	-508,23
SANOSTRA	60.237,58	59.812,39	-425,19	7.062,91	7.168,89	105,98	3.805,50	4.422,98	617,48	6.281,42	4.428,63	-1.852,79
CAJA MADRID	79.852,79	79.153,88	-698,91	152.215,10	153.238,24	1.023,14	107.205,51	107.749,52	544,01	90.626,24	90.411,06	-215,18
CAJAMAR	583.570,29	582.523,96	-1.046,33	620.485,84	623.312,03	2.826,19	1.026.337,48	1.026.234,27	-103,21	4.667.016,02	4.701.163,87	34.147,85
CAJASIETE	430.995,81	430.676,44	-319,37	344.985,57	346.944,64	1.959,07	220.556,75	226.637,90	6.081,15	278.443,55	278.376,85	-66,70
CAJA INSULAR AHORROS	445.860,54	429.728,94	-16.131,60	483.112,68	546.092,81	62.980,13	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	819.704,04	822.350,52	2.646,48	350.323,81	383.157,12	32.833,31	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	17.607,33	17.578,64	-28,69	17.967,21	19.536,65	1.569,44	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAJA GRAL. AHORROS	88.971,61	88.524,99	-446,62	44.749,53	46.960,68	2.211,15	1.469,79	1.151,42	-318,37	0,00	0,00	0,00
	64.028,45	62.987,35	-1.041,10	4.185,74	4.827,42	641,68	256,63	319,55	62,92	0,00	0,00	0,00
	20.504,10	15.781,52	-4.722,58	13.198,43	14.101,71	903,28	277,17	254,29	-22,88	0,00	0,00	0,00
	393.556,18	401.103,32	7.547,14	320.613,32	338.094,96	17.481,64	39.659,38	19.331,29	-20.328,09	0,00	0,00	0,00
TOTALES	5.378.504,46	5.368.432,40	-10.072,06	4.291.223,24	4.437.062,93	145.839,69	4.559.164,57	4.602.319,28	43.154,71	6.700.700,68	6.884.533,98	183.833,30

Para determinar la representatividad de los intereses analizados, se utilizó el criterio de los intereses calculados sobre el volumen de intereses contabilizados. Ello se refleja en el siguiente cuadro:

AÑO	2011	2012	2013	2014
Intereses comprobados (A)	5.368.432,40	4.437.062,93	4.602.319,28	6.884.533,98
Total de intereses (B)	13.804.323,61	5.779.854,87	4.071.397,78	6.446.862,40
B/A%	38,89%	76,77%	113,04%	106,79%

Los años 2013 y 2014 presentan un porcentaje superior al cien por cien porque la fecha de contabilización tiene un cierto retraso respecto a la fecha de devengo de los intereses. En el global de los cuatro años se han contabilizado un total de 30.102.438,66 €, y se han comprobado un total de 21.292.648,59 €, lo que representa un 70,73% del total del periodo.

El detalle por Bancos del cuadro-resumen anterior, desglosado por cuenta corriente y por liquidaciones trimestrales, figura en el anexo de este informe.

El resumen de las diferencias entre los intereses calculados y los ingresados por año se concreta en el siguiente cuadro:

AÑO	DIFERENCIA
2011	-10.072,06
2012	145.839,69
2013	43.154,71
2014	183.833,30
TOTAL	362.755,64

(Deducido del 70,73% de los fondos analizados).

Por tanto, se puede afirmar que la gestión de la rentabilidad de los fondos líquidos de la CAC, en el periodo analizado, ha sido acertada, al haber obtenido 363 mil Euros de más que el interés pactado en los convenios de apertura de las cuentas y sus correspondientes renovaciones.

3. TRAMITE DE ALEGACIONES

El presente Informe, antes de su aprobación definitiva, ha sido remitido para alegaciones, de conformidad con lo establecido en el art. 23 del Reglamento de Organización y Funcionamiento de la Audiencia de Cuentas de Canarias.

A estos efectos, el Proyecto de Informe fue remitido a la Intervención General, de conformidad con lo dispuesto en el art. 42 de la Ley 4/1989, mediante escrito de 9 de noviembre de 2015, concediéndosele un plazo de 7 días, prorrogado por otros 7 días a solicitud de la misma.

Así mismo, el Proyecto de Informe también fue remitido a la Dirección General del Tesoro Y Política Financiera, mediante escrito de 9 de noviembre de 2015, concediéndosele un plazo de 7 días, prorrogado por otros 7 días a solicitud de la misma.

La Intervención General formula las alegaciones mediante escrito de fecha 25 de noviembre de 2015, así como el 27 de noviembre de 2015, la Intervención General, remiten alegaciones de la Dirección General del Tesoro Y Política Financiera.

La Dirección General del Tesoro Y Política Financiera formula las alegaciones mediante escrito de fecha 25 de noviembre de 2015.

En el Anexo IV se incorpora, por parte de la Audiencia de Cuentas de Canarias, la contestación a las mismas, tanto a las no aceptadas como a las aceptadas, total o parcialmente, indicándose en este último caso las modificaciones llevadas a cabo en el texto del Informe.

4. CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES

4.1. Conclusiones.

1. La Dirección General del Tesoro de la CAC ha corregido acertadamente las deficiencias e irregularidades puestas de manifiesto por el informe de la Audiencia de Cuentas de Canarias del año 2002. Los avances se evidencian en los siguientes aspectos: incremento y mejora de la organización de los recursos humanos dedicados a la gestión del Tesoro; desarrollo e implementación de sistemas de información y nuevas herramientas informáticas que optimizan las funciones de gestión y control de los fondos líquidos de la CAC (Epígrafe 2.1).
2. La Administración Autónoma, ha promovido un desarrollo normativo acorde con las exigencias y crecimiento del volumen de cobros y pagos de la CAC. En particular, debe destacarse la modificación legislativa de 2014 (artículo 8 de la Ley 9/2014, de 6 de noviembre, de medidas tributarias, administrativas y sociales de Canarias, que modifica el artículo 70 de la Ley 11/2006, de 11 de diciembre, de la Hacienda Pública Canaria), que centraliza, en la D.G. del Tesoro y Política Financiera, la ordenación y materialización de los pagos de todos los entes públicos autonómicos con presupuesto limitativo (Epígrafe 2.1).
3. El saldo final de existencias metálicas que ofrece el Acta de Arqueo no cuadra, en ninguno de los años a los que se refiere esta fiscalización, con el saldo final de existencias metálicas que arroja el Estado de Situación de Fondos de cada ejercicio (Epígrafe 2.2.1).
4. El Registro de Cuentas de la Tesorería, regulado por el artículo 16 de la Orden de 22 de julio de 2004, de la Consejería de Economía y Hacienda, por la que se regula el régimen de funcionamiento y gestión de las cuentas bancarias y de los fondos integrantes en la Tesorería de la Comunidad Autónoma y sus Organismos Autónomos, no cumple lo estipulado por los apartados c), d), f), g), y h) del citado artículo (Epígrafe 2.2.2), manifestándose por la Dirección General del Tesoro y Política Financiera, en fase de alegaciones, que se están gestionando la información de dicho Registro en el SEFLOGIC.
5. La información de las cuentas operativas se contrasta mediante el mecanismo de la conciliación bancaria de estas cuentas. De las pruebas, comprobaciones y verificaciones realizadas se puede afirmar que el proceso de conciliación de los saldos bancarios de las cuentas del Tesoro de la CAC, con el saldo de cada cuenta corriente operativa, según la contabilidad de la Administración de la CAC, es sólido, fiable y consistente. Ello representa un avance muy considerable respecto a la situación existente en el ejercicio 2002 (Epígrafe 2.2.4).
6. El Periodo Medio de Pago (PMP) de la Tesorería de la CAC está por debajo del nº de días fijado por la legislación aplicable en cada momento (30-60-30). Destaca el PMP

de la Tesorería de la CAC, sin computar los organismos autónomos, que en el año 2014 se situó en 27,06 días. El Periodo Medio de Pago de la Tesorería de CAC cumple con el plazo establecido por la LCSP para el pago a los proveedores (Epígrafe 2.3.4).

7. Los anticipos de tesorería, regulados por el artículo 87.1 de la Ley 11/2006, de 11 de diciembre, de la Hacienda Pública de Canarias, han sido cancelados antes de finalizar el año desde su concesión, según se deduce de los registros contables y de la documentación analizada, tal como regula la normativa vigente (Epígrafe 2.4).
8. Según se deduce de los presupuestos de tesorería, se observa que el saldo final mensual de las existencias de tesorería, de los 48 meses analizados, supera los 200 millones de €, salvo en cuatro casos. Quince meses arrojan cifras superiores a los 500 millones de € (Epígrafes 2.4 y 2.5).
9. De los 41 préstamos analizados, correspondientes al periodo 2011-2014, se observa que 11 préstamos aplicaron un tipo de interés mayor que la media aritmética de los tipos aplicados en el año de su contratación en el mercado español; 19 préstamos aplicaron un tipo de interés mayor que la media aritmética de los tipos aplicados en el año de su contratación en el mercado europeo; 21 préstamos aplicaron un tipo de interés menor que la media aritmética de los tipos aplicados en el año de su contratación en el mercado europeo (Epígrafe 2.6.1).
10. Los tipos aplicados a los préstamos del ICO (Fondo Liquidez Autonómico FLA), contratados en el año 2014, han resultado con el coste más barato del periodo analizado, para la totalidad de la financiación ajena, ya sea vía préstamo, ya sea vía deuda. Salvo en el ejercicio de 2014, los tipos aplicados están por encima del tipo medio europeo, y por debajo del español (Epígrafe 2.6.1).
11. Los tipos de todas las emisiones de deuda del Gobierno de Canarias han sido más bajos que las medias españolas y europeas. El importante ahorro en intereses, respecto a las emisiones comparadas, se debe fundamentalmente a las ventajas fiscales que proporcionaba la suscripción de esa deuda, al poder ser aplicada para la materialización del 50% de la dotación para la Reserva de Inversión en Canarias (RIC) (Epígrafe 2.6.2).
12. Analizados los ejercicios 2011, 2012, 2013 y 2014, se observa que la Dirección General del Tesoro y Política Financiera ha adjudicado el pago del IRPF a través de las entidades que ofrecen las mejores condiciones recibidas, y que las liquidaciones practicadas han sido acordes con las condiciones pactadas (Epígrafe 2.7).
13. La gestión de la rentabilidad de los fondos líquidos de la CAC, en el periodo analizado, ha sido acertada, al haber obtenido 363 mil Euros de más que el interés pactado en los convenios de apertura de las cuentas y sus correspondientes renovaciones (Epígrafe 2.8).

4.2. Recomendaciones.

1. Debería diseñarse un proceso informático contable que asegure la consistencia de datos entre las existencias metálicas del Acta de Arqueo, y el saldo final del Estado de Situación de Fondos.
2. El Registro de Cuentas Corrientes regulado por el artículo 16 de la Orden de 22 de julio de 2004, de la Consejería de Economía y Hacienda, por la que se regula el régimen de funcionamiento y gestión de las cuentas bancarias y de los fondos integrantes en la Tesorería de la Comunidad Autónoma y sus Organismos Autónomos, debería informatizarse para asegurar el pleno cumplimiento del mismo, culminando el proceso que la Dirección General del Tesoro y Política Financiera manifiesta haber iniciado en tal sentido.
3. Se recomienda que por parte de la Dirección General del Tesoro o por la Intervención Delegada en el Tesoro, se realice una circularización anual de todas las posiciones activas y pasivas de la Tesorería de la CAC.
4. Debería ajustarse el importe de recursos ajenos contratados cada año a las necesidades reales de tesorería, de acuerdo con la evolución real del presupuesto de tesorería, ello redundaría en una deseable reducción de los gastos financieros de la CAC. Debe evitarse suscribir productos de financiación ajena que no sean necesarios. El endeudamiento en exceso genera gastos financieros innecesarios.
5. Con el fin de llevar a cabo un mejor control de las liquidaciones de intereses, los mandamientos de ingresos deberían individualizarse por cada cuenta en función de los intereses que se liquidan y el periodo a que pertenecen.
6. Se estima que una vez recibida las distintas ofertas de rentabilización de los fondos propios, la CAC debería tender a que todas las entidades igualen a la mejor de las recibidas. En el supuesto de que eso no fuera posible, se recomienda distribuir los recursos entre las distintas entidades en proporción a la rentabilidad ofrecida.

Santa Cruz de Tenerife, a 10 de diciembre de 2015
EL PRESIDENTE

Fdo.: Rafael Díaz Martínez

ANEXOS

**ANEXO I. Tipos de interés de los PRÉSTAMOS contratados en el periodo 2011-2014 en los mercados europeo y español
(Emisión de préstamos en ESPAÑA en el periodo comprendido entre el 01/01/2011 hasta el 31/12/2014 – Fuente Bloomberg)**

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	País
Xacom Comunicaciones SL	Variable	02/02/2011	02/02/2016	EUR	5.000.000	5.000.000	350	4,127%	-	Electrical Equipment Manufacturing	ES
Gala Fund Energy & Infraestructure SL	Variable	18/02/2011	25/02/2016	EUR	19.900.000	19.900.000	400	4,312%	-	Power Generation	ES
Patentes Talgo SLU	Variable	04/03/2011	04/03/2016	EUR	80.000.000	80.000.000	250	3,407%	-	Railroad	ES
Bilbao Ria 2000 SA	Variable	10/03/2011	10/03/2016	EUR	50.000.000	50.000.000	340	4,208%	-	Industrial Other	ES
CLH SA	Variable	18/03/2011	18/03/2016	EUR	17.560.000	87.800.000	350	3,753%	-	Pipeline	ES
Grupo BC de Asesoría Hipotecaria SL	Variable	25/03/2011	25/03/2016	EUR	9.000.000	9.000.000	350	4,387%	-	Consumer Services	ES
Hijos De Juan De Garay SA	Variable	30/03/2011	30/03/2016	EUR	1.500.000	1.500.000	450	5,462%	-	Metals & Mining	ES
Telefonica SA	Variable	12/05/2011	28/07/2016	EUR	2.000.000.000	2.000.000.000	95	16,652%	-	Wireless Telecommunications Services	ES
Sogefi Filtration SA	Variable	30/05/2011	30/05/2016	EUR	2.100.000	7.000.000	225	2,851%	-	Auto Parts Manufacturing	ES
Itinere Infraestructuras SA	Variable	03/08/2011	31/01/2016	EUR	30.986.700	30.986.700	350	4,064%	-	Industrial Other	ES
Itinere Infraestructuras SA	Variable	03/08/2011	31/01/2016	EUR	30.986.700	30.986.700	350	4,148%	-	Industrial Other	ES
Terminal Catalunya SA	Variable	19/08/2011	19/08/2016	EUR	280.000.000	280.000.000	88	1,651%	-	Transportation & Logistics	ES
CTC Externalizacion SL	Variable	17/04/2012	17/04/2017	EUR	-	1.250.000	400	4,282%	-	Transportation & Logistics	ES
CTC Externalizacion SL	Variable	17/04/2012	17/04/2017	EUR	-	3.000.000	400	4,282%	-	Transportation & Logistics	ES
Cableuropa SAU	Variable	24/05/2012	30/06/2017	EUR	639.000.000	890.700.000	450	3,804%	-	Wireline Telecommunications Services	ES
Agencia Catalana del Agua	Variable	30/05/2012	30/03/2017	EUR	291.875.000	291.875.000	437	4,559%	-	Utilities	ES
Autoestrada Ourense Celanova Sociedade Concessionaria da Xunta de Galicia SA	Variable	26/06/2012	30/03/2017	EUR	-	52.000.000	450	4,507%	-	Industrial Other	ES
Bamesa Aceros	Variable	27/07/2012	19/05/2017	EUR	60.900.000	60.900.000	375	3,653%	-	Metals & Mining	ES
Bamesa Aceros	Variable	27/07/2012	19/05/2017	EUR	72.000.000	72.000.000	375	3,653%	-	Metals & Mining	ES
Cemex Espana SA	Variable	17/09/2012	14/02/2017	EUR	544.391.000	808.378.000	500	5,137%	-	Electrical Equipment Manufacturing	ES
Cemex Espana SA	Variable	17/09/2012	14/02/2017	EUR	193.984.000	288.051.000	500	4,838%	-	Electrical Equipment Manufacturing	ES
Cortefiel SA	Variable	22/10/2012	20/03/2017	EUR	-	263.000.000	525	18,551%	-	Retail - Consumer Discretionary	ES

Cortefiel SA	Variable	22/10/2012	20/03/2017	EUR	-	287.000.000	525	18,551%	-	Retail - Consumer Discretionary	ES
Cortefiel SA	Variable	22/10/2012	22/10/2017	EUR	-	6.900.000	375	11,466%	-	Retail - Consumer Discretionary	ES
Bagoeta SL	Variable	30/11/2012	30/11/2017	EUR	60.370.000	60.370.000	400	3,994%	-	Metals & Mining	ES
Imaginarium SA	Variable	12/12/2012	12/12/2017	EUR	12.000.000	12.000.000	475	4,903%	-	Retail - Consumer Discretionary	ES
Gestamp Automocion SA	Variable	07/02/2013	07/02/2018	EUR	-	40.000.000	375	3,936%	-	Auto Parts Manufacturing	ES
Telefonica SA	Variable	22/02/2013	22/02/2018	EUR	0	700.000.000	210	2,151%	-	Wireless Telecommunications Services	ES
Federico Joly y Cia SL	Variable	26/06/2013	26/06/2018	EUR	1.000.000	1.000.000	325	3,612%	-	Publishing & Broadcasting	ES
Federico Joly y Cia SL	Variable	26/06/2013	26/06/2018	EUR	1.750.000	1.750.000	325	3,612%	-	Publishing & Broadcasting	ES
Copcisa Corp SLU	Variable	30/07/2013	06/11/2018	EUR	72.214.100	72.214.100	200	2,415%	-	Financial Services	ES
Copcisa Corp SLU	Variable	30/07/2013	06/11/2018	EUR	2.200.000	2.200.000	200	2,395%	-	Financial Services	ES
Copcisa Corp SLU	Variable	30/07/2013	06/11/2018	EUR	1.700.000	1.700.000	200	2,395%	-	Financial Services	ES
Copcisa Corp SLU	Variable	30/07/2013	06/11/2018	EUR	7.684.010	7.684.010	200	2,395%	-	Financial Services	ES
Noa Visual Group SLU	Variable	25/09/2013	31/07/2018	EUR	10.000.000	10.000.000	500	5,085%	-	Consumer Services	ES
Befesa Medio Ambiente SA	Variable	27/09/2013	27/06/2018	EUR	75.000.000	75.000.000	425	4,640%	-	Waste & Environment Services & Equipment	ES
Befesa Medio Ambiente SA	Variable	27/09/2013	27/06/2018	EUR	60.000.000	60.000.000	475	4,861%	-	Waste & Environment Services & Equipment	ES
Gas Natural SDG SA	Variable	28/10/2013	28/12/2018	EUR	750.000.000	750.000.000	160	1,937%	-	Utilities	ES
Enaitinere SLU	Variable	31/10/2013	31/10/2018	EUR	-	1.176.240.000	300	3,402%	-	Industrial Other	ES
Promotora de Informaciones SA	Variable	11/12/2013	11/12/2018	EUR	646.739.000	646.739.000	260	2,305%	-	Publishing & Broadcasting	ES
Vocento SA	Variable	21/02/2014	21/10/2018	EUR	75.000.000	75.000.000	475	4,825%	-	Publishing & Broadcasting	ES
Vocento SA	Variable	21/02/2014	21/02/2019	EUR	55.000.000	55.000.000	350	4,383%	-	Publishing & Broadcasting	ES
Parques Reunidos Servicios Centrales SAU	Variable	04/06/2014	29/09/2019	EUR	119.000.000	119.000.000	650	6,790%	-	Entertainment Resources	ES
Parques Reunidos Servicios Centrales SAU	Variable	04/06/2014	26/03/2019	EUR	350.634.000	350.634.000	500	4,710%	-	Entertainment Resources	ES
Parques Reunidos Servicios Centrales SAU	Variable	04/06/2014	26/03/2019	EUR	-	1.000.000	500	4,711%	-	Entertainment Resources	ES
Parques Reunidos Servicios Centrales SAU	Variable	04/06/2014	26/03/2019	EUR	297.454.000	297.454.000	500	4,711%	-	Entertainment Resources	ES
Grupo Ferrer Internacional SA	Variable	26/06/2014	26/06/2019	EUR	150.000.000	150.000.000	325	4,682%	-	Pharmaceuticals	ES
Parc Logistic de La Zona Franca SA	Variable	30/06/2014	30/06/2019	EUR	36.000.000	36.000.000	275	3,757%	-	Real Estate	ES
Xfera Moviles SA	Variable	18/07/2014	18/07/2019	EUR	130.000.000	130.000.000	300	4,410%	-	Wireless Telecommunications Services	ES
Clinicas Del Sur SL	Variable	31/07/2014	31/07/2019	EUR	44.300.000	44.300.000	275	3,657%	-	Health Care Facilities & Services	ES

Eroski S Coop	Variable	01/08/2014	31/07/2019	EUR	948.000.000	948.000.000	375	4,704%	-	Supermarkets & Pharmacies	ES
URO Property Holdings SL	Variable	01/08/2014	22/11/2019	EUR	1.450.000.000	1.450.000.000	300	3,682%	-	Financial Services	ES
Grupo de Empresas Azvi SL	Variable	09/10/2014	09/10/2019	EUR	78.719.100	78.719.100	450	5,140%	-	Industrial Other	ES
Grupo de Empresas Azvi SL	Variable	09/10/2014	09/10/2019	EUR	9.500.000	9.500.000	450	5,140%	-	Industrial Other	ES
Famosa SA	Variable	05/12/2014	05/12/2019	EUR	20.000.000	20.000.000	325	4,383%	-	Leisure Products Manufacturing	ES

Tipos de interés de los PRÉSTAMOS contratados en el periodo 2011-2014 en los mercados europeo y español

(Emisión de préstamos en EUROPA en el periodo comprendido entre el 01/01/2011 hasta el 31/12/2014– Fuente Bloomberg)

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
BCD OTA BV	Variable	18/01/2011	18/01/2016	EUR	40.000.000	40.000.000	275	3,157%	-	Entertainment Resources	-	NL
Manutencoop Facility Management SpA	Variable	24/01/2011	31/12/2015	EUR	25.495.000	50.000.000	140	5,231%	-	Consumer Services	-	IT
Xacom Comunicaciones SL	Variable	02/02/2011	02/02/2016	EUR	5.000.000	5.000.000	350	4,127%	-	Electrical Equipment Manufacturing	-	ES
Gala Fund Energy & Infraestructure SL	Variable	18/02/2011	25/02/2016	EUR	19.900.000	19.900.000	400	4,312%	-	Power Generation	-	ES
Cremonini Produzione SPA	Variable	02/03/2011	02/03/2016	EUR	220.000.000	220.000.000	300	3,180%	-	Food & Beverage	-	IT
Cremonini Produzione SPA	Variable	02/03/2011	02/03/2016	EUR	98.210.000	98.210.000	350	3,222%	-	Food & Beverage	-	IT
Patentes Talgo SLU	Variable	04/03/2011	04/03/2016	EUR	80.000.000	80.000.000	250	3,407%	-	Railroad	-	ES
Bilbao Ria 2000 SA	Variable	10/03/2011	10/03/2016	EUR	50.000.000	50.000.000	340	4,208%	-	Industrial Other	-	ES
CLH SA	Variable	18/03/2011	18/03/2016	EUR	17.560.000	87.800.000	350	3,753%	-	Pipeline	-	ES
Lucas Bols BV	Variable	24/03/2011	24/09/2016	EUR	41.320.000	41.320.000	475	5,058%	-	Food & Beverage	-	NL
Grupo BC de Asesoría Hipotecaria SL	Variable	25/03/2011	25/03/2016	EUR	9.000.000	9.000.000	350	4,387%	-	Consumer Services	-	ES
Hijos De Juan De Garay SA	Variable	30/03/2011	30/03/2016	EUR	1.500.000	1.500.000	450	5,462%	-	Metals & Mining	-	ES
Fraikin SAS	Variable	20/04/2011	20/04/2016	EUR	330.000.000	330.000.000	275	8,526%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	FR
Balta Finance Sarl	Variable	26/04/2011	30/11/2016	EUR	-	130.000.000	475	4,768%	-	Financial Services	-	LU
ClientLogic Holding Ltd	Variable	12/05/2011	30/01/2017	EUR	21.927.800	21.927.800	675	5,714%	-	Software & Services	-	GB
Telefonica SA	Variable	12/05/2011	28/07/2016	EUR	2.000.000.000	2.000.000.000	95	16,652%	-	Wireless Telecommunications Services	-	ES
Opale Defense	Variable	30/05/2011	28/02/2016	EUR	-	665.000.000	195	1,577%	-	Consumer Services	-	FR
Opale Defense	Variable	30/05/2011	28/02/2016	EUR	-	78.000.000	150	1,586%	-	Consumer Services	-	FR
Sogefi Filtration SA	Variable	30/05/2011	30/05/2016	EUR	2.100.000	7.000.000	225	2,851%	-	Auto Parts Manufacturing	-	ES
Eredvisie Media & Marketing CV	Variable	17/06/2011	17/06/2016	EUR	60.000.000	60.000.000	360	5,139%	-	Entertainment Content	-	NL
Nordzucker AG	Variable	17/06/2011	17/06/2016	EUR	200.450.000	200.450.000	90	1,687%	-	Food & Beverage	-	DE
Valeo SA	Variable	27/06/2011	27/06/2016	EUR	249.000.000	250.000.000	130	2,136%	-	Auto Parts Manufacturing	-	FR
Nuova Rete Solare Srl	Variable	28/07/2011	27/07/2016	EUR	-	20.000.000	200	2,172%	-	Renewable Energy	-	IT

Terminal Catalunya SA	Variable	19/08/2011	19/08/2016	EUR	280.000.000	280.000.000	88	1,651%	-	Transportation & Logistics	-	ES
3 AB Optique Financement	Variable	23/08/2011	23/08/2016	EUR	73.333.300	220.000.000	250	3,022%	-	Financial Services	-	FR
Ryder Capital Luxembourg Ltd SARL	Variable	31/08/2011	31/08/2016	EUR	165.000.000	165.000.000	125	2,051%	-	Transportation & Logistics	-	GB
TV GFI Holding Co Sarl	Variable	14/09/2011	14/09/2016	EUR	31.040.000	31.040.000	525	5,074%	-	Software & Services	-	LU
Euromedic International Holdings BV	Variable	16/09/2011	16/09/2016	EUR	125.000.000	125.000.000	225	2,680%	-	Health Care Facilities & Services	-	HU
Euromedic International Holdings BV	Variable	16/09/2011	16/09/2016	EUR	102.000.000	102.000.000	225	2,680%	-	Health Care Facilities & Services	-	HU
Oleon Holding NV	Variable	26/09/2011	26/09/2016	EUR	40.000.000	40.000.000	195	2,261%	-	Chemicals	-	BE
Scotch & Soda BV	Variable	28/09/2011	03/10/2016	EUR	85.000.000	85.000.000	400	4,402%	-	Apparel & Textile Products	-	NL
Bucuresti Turism SA	Variable	29/09/2011	30/06/2016	EUR	62.500.000	62.500.000	460	4,346%	-	Travel & Lodging	-	RO
Bucuresti Turism SA	Variable	29/09/2011	30/06/2016	EUR	-	9.000.000	460	4,275%	-	Travel & Lodging	-	RO
Sponda OYJ	Variable	03/11/2011	03/11/2016	EUR	275.000.000	275.000.000	170	2,137%	-	Real Estate	-	FI
Q-Park NV	Variable	15/11/2011	15/11/2016	EUR	650.000.000	650.000.000	250	2,578%	-	Consumer Services	-	NL
Q-Park NV	Variable	15/11/2011	15/11/2016	EUR	275.000.000	275.000.000	250	2,578%	-	Consumer Services	-	NL
Aventas Manufacturing Group Holdco Ltd	Variable	02/12/2011	02/12/2016	EUR	72.351.200	72.351.200	677	9,670%	-	Consumer Services	-	GB
Novy Urengoy Gas & Chemical Complex	Variable	08/12/2011	08/12/2016	EUR	65.000.000	65.000.000	195	2,255%	-	Exploration & Production	-	RU
Domodedovo Airport ZAO	Variable	20/01/2012	20/01/2017	EUR	165.000.000	165.000.000	280	3,480%	-	Transportation & Logistics	-	RU
Synlab Holding mbH	Variable	27/01/2012	27/01/2017	EUR	75.000.000	75.000.000	475	4,460%	-	Health Care Facilities & Services	-	DE
Touleen Group	Variable	30/01/2012	30/01/2017	EUR	12.000.000	12.000.000	250	3,082%	-	Food & Beverage	-	IE
Sberbank of Russia	Variable	15/02/2012	15/02/2017	EUR	500.000.000	500.000.000	150	1,935%	-	Banks	-	RU
Enel Finance International NV	Variable	20/02/2012	20/02/2017	EUR	3.200.000.000	3.200.000.000	250	2,635%	-	Utilities	-	NL
Enel Finance International NV	Variable	20/02/2012	20/02/2017	EUR	100.000.000	100.000.000	230	2,928%	-	Utilities	-	NL
Buffet Crampon SAS	Variable	29/03/2012	15/06/2017	EUR	12.000.000	12.000.000	300	3,307%	-	Leisure Products Manufacturing	-	FR
CTC Externalizacion SL	Variable	17/04/2012	17/04/2017	EUR	-	1.250.000	400	4,282%	-	Transportation & Logistics	-	ES
CTC Externalizacion SL	Variable	17/04/2012	17/04/2017	EUR	-	3.000.000	400	4,282%	-	Transportation & Logistics	-	ES
Rosneft OAO	Variable	24/04/2012	24/04/2017	EUR	845.000.000	845.000.000	240	2,710%	-	Integrated Oils	-	RU
Cableuropa SAU	Variable	24/05/2012	30/06/2017	EUR	639.000.000	890.700.000	450	3,804%	-	Wireline Telecommunications Services	-	ES
Agencia Catalana del Agua	Variable	30/05/2012	30/03/2017	EUR	291.875.000	291.875.000	437	4,559%	-	Utilities	-	ES
AVIO SpA	Variable	30/05/2012	14/06/2017	EUR	119.824.000	119.824.000	288	3,162%	-	Aerospace & Defense	-	IT
AVIO SpA	Variable	30/05/2012	14/06/2017	EUR	194.705.000	194.705.000	288	3,162%	-	Aerospace & Defense	-	IT

Autoestrada Ourense Celanova Sociedade Concesionaria da Xunta de Galicia SA	Variable	26/06/2012	30/03/2017	EUR	-	52.000.000	450	4,507%	-	Industrial Other	-	ES
Coillte Teoranta	Variable	27/06/2012	27/06/2017	EUR	10.447.000	10.447.000	250	2,645%	-	Forest & Paper Products Manufacturing	-	IE
Premia FFL AS	Variable	18/07/2012	18/07/2017	EUR	3.900.000	10.900.000	190	2,830%	-	Food & Beverage	-	LV
Ekspress Grupp AS	Variable	23/07/2012	25/07/2017	EUR	22.403.000	29.300.000	250	4,065%	-	Distributors - Consumer Discretionary	-	EE
Accent Jobs For People NV	Variable	27/07/2012	27/07/2017	EUR	50.700.000	50.700.000	350	4,370%	-	Consumer Services	-	BE
Bamesa Aceros	Variable	27/07/2012	19/05/2017	EUR	72.000.000	72.000.000	375	3,653%	-	Metals & Mining	-	ES
Bamesa Aceros	Variable	27/07/2012	19/05/2017	EUR	60.900.000	60.900.000	375	3,653%	-	Metals & Mining	-	ES
Letisko Mrstefanika-Airport Bratislava AS	Variable	31/07/2012	31/07/2017	EUR	30.000.000	30.000.000	445	4,484%	-	Transportation & Logistics	-	SK
Limoni SpA	Variable	02/08/2012	02/01/2018	EUR	-	74.000.000	25	2,309%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	IT
Fokker Technologies Holding BV	Variable	03/08/2012	03/08/2017	EUR	150.000.000	150.000.000	800	7,464%	-	Aerospace & Defense	96,000	NL
Citycon OYJ	Variable	04/09/2012	04/09/2017	EUR	184.400.000	190.000.000	210	2,283%	-	Real Estate	-	FI
Cemex Espana SA	Variable	17/09/2012	14/02/2017	EUR	544.391.000	808.378.000	500	5,137%	-	Electrical Equipment Manufacturing	-	ES
Cemex Espana SA	Variable	17/09/2012	14/02/2017	EUR	193.984.000	288.051.000	500	4,838%	-	Electrical Equipment Manufacturing	-	ES
IMO Car Wash Group Ltd	Variable	05/10/2012	05/10/2017	EUR	27.600.000	27.600.000	750	7,684%	-	Consumer Services	-	GB
Cortefiel SA	Variable	22/10/2012	20/03/2017	EUR	-	263.000.000	525	18,551%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	ES
Cortefiel SA	Variable	22/10/2012	20/03/2017	EUR	-	287.000.000	525	18,551%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	ES
Cortefiel SA	Variable	22/10/2012	22/10/2017	EUR	-	6.900.000	375	11,466%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	ES
Rottapharm SpA	Variable	14/11/2012	14/11/2017	EUR	60.000.000	100.000.000	350	4,768%	-	Pharmaceuticals	-	IT
Bagoeta SL	Variable	30/11/2012	30/11/2017	EUR	60.370.000	60.370.000	400	3,994%	-	Metals & Mining	-	ES
Interxion Real Estate IV BV	Variable	30/11/2012	01/12/2017	EUR	8.666.670	10.000.000	275	3,367%	-	Wireline Telecommunications Services	-	NL
Imaginarium SA	Variable	12/12/2012	12/12/2017	EUR	12.000.000	12.000.000	475	4,903%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	ES
Imaginarium SA	Variable	12/12/2012	12/12/2016	EUR	10.000.000	10.000.000	350	4,358%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	ES
Doosan Power System SA	Variable	27/12/2012	27/12/2017	EUR	100.000.000	100.000.000	275	3,057%	-	Industrial Other	-	LU
Editis SA	Variable	22/01/2013	22/01/2018	EUR	380.000.000	380.000.000	350	3,821%	-	Publishing & Broadcasting	-	FR
TIGF SA	Variable	04/02/2013	04/02/2018	EUR	200.000.000	200.000.000	150	2,429%	-	Utilities	-	FR
Gestamp Automocion SA	Variable	07/02/2013	07/02/2018	EUR	-	40.000.000	375	3,936%	-	Auto Parts Manufacturing	-	ES

Telefonica SA	Variable	22/02/2013	22/02/2017	EUR	0	700.000.000	200	2,016%	-	Wireless Telecommunications Services	-	ES
Telefonica SA	Variable	22/02/2013	22/02/2018	EUR	0	700.000.000	210	2,151%	-	Wireless Telecommunications Services	-	ES
Toys R Us France Real Estate SAS	Variable	27/02/2013	27/02/2018	EUR	46.437.000	48.000.000	450	6,270%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	FR
Global Blue Acquisition BV	Variable	08/03/2013	31/07/2018	EUR	120.000.000	120.000.000	425	4,222%	-	Financial Services	-	NL
Ziggo BV	Variable	28/03/2013	28/03/2018	EUR	150.000.000	150.000.000	200	1,708%	-	Entertainment Content	-	NL
Spotless Group SAS	Variable	10/04/2013	31/12/2017	EUR	70.000.000	70.000.000	500	4,783%	-	Consumer Products	-	FR
SAG GmbH	Variable	19/04/2013	31/12/2017	EUR	97.500.000	97.500.000	275	3,155%	-	Power Generation	-	DE
SAG GmbH	Variable	19/04/2013	31/12/2017	EUR	97.500.000	97.500.000	325	3,548%	-	Power Generation	-	DE
Gaming Invest SARL	Variable	01/05/2013	31/12/2017	EUR	165.000.000	165.000.000	400	9,079%	-	Casinos & Gaming	-	LU
Deutsche Annington Rhein-Ruhr GmbH & Co KG	Variable	17/05/2013	26/06/2018	EUR	104.000.000	104.000.000	225	2,923%	-	Financial Services	-	DE
Deutsche Annington Wohnungsgesellschaft I mbH	Variable	17/05/2013	26/06/2018	EUR	75.000.000	75.000.000	225	3,082%	-	Real Estate	-	DE
Bonhom SAS	Variable	03/06/2013	31/12/2018	EUR	-	225.000.000	600	7,064%	-	Manufactured Goods	-	FR
Capio Group Services AB	Variable	03/06/2013	02/11/2017	EUR	113.652.000	113.652.000	425	4,190%	-	Health Care Facilities & Services	-	SE
Interxion Real Estate V BV	Variable	21/06/2013	01/05/2018	EUR	5.200.000	6.000.000	275	3,450%	-	Wireline Telecommunications Services	-	NL
Brussels Airport Co NV/SA	Variable	26/06/2013	26/06/2018	EUR	800.000.000	800.000.000	140	1,998%	-	Transportation & Logistics	-	BE
Federico Joly y Cia SL	Variable	26/06/2013	26/06/2018	EUR	1.000.000	1.000.000	325	3,612%	-	Publishing & Broadcasting	-	ES
Federico Joly y Cia SL	Variable	26/06/2013	26/06/2018	EUR	1.750.000	1.750.000	325	3,612%	-	Publishing & Broadcasting	-	ES
Infront Sports & Media AG	Variable	19/07/2013	01/06/2019	EUR	-	200.000.000	500	4,759%	-	Advertising & Marketing	98,000	CH
Infront Sports & Media AG	Variable	19/07/2013	01/06/2018	EUR	-	70.000.000	438	4,371%	-	Advertising & Marketing	-	CH
Telekom Romania Communications SA	Variable	24/07/2013	30/04/2018	EUR	75.000.000	75.000.000	525	6,962%	-	Wireless Telecommunications Services	-	RO
Telekom Romania Communications SA	Variable	24/07/2013	30/04/2018	EUR	150.000.000	150.000.000	525	6,962%	-	Wireless Telecommunications Services	-	RO
Attendo Group AB	Variable	26/07/2013	31/12/2018	EUR	225.000.000	225.000.000	450	4,082%	-	Health Care Facilities & Services	98,000	SE
Copcisa Corp SLU	Variable	30/07/2013	06/11/2018	EUR	72.214.100	72.214.100	200	2,415%	-	Financial Services	-	ES
Copcisa Corp SLU	Variable	30/07/2013	06/11/2018	EUR	2.200.000	2.200.000	200	2,395%	-	Financial Services	-	ES
Copcisa Corp SLU	Variable	30/07/2013	06/11/2018	EUR	1.700.000	1.700.000	200	2,395%	-	Financial Services	-	ES
Copcisa Corp SLU	Variable	30/07/2013	06/11/2018	EUR	7.684.010	7.684.010	200	2,395%	-	Financial Services	-	ES

Hilding Anders International AB	Variable	02/09/2013	30/06/2018	EUR	87.026.400	87.026.400	550	5,632%	-	Home & Office Products Manufacturing	-	SE
AmRest Holdings SE	Variable	10/09/2013	10/09/2018	EUR	149.155.000	150.000.000	319	4,238%	-	Restaurants	-	PL
Metallum Holding SA	Variable	13/09/2013	13/09/2018	EUR	50.000.000	50.000.000	450	4,539%	-	Waste & Environment Services & Equipment	-	LU
Metallum Holding SA	Variable	13/09/2013	13/09/2018	EUR	-	35.000.000	450	4,517%	-	Waste & Environment Services & Equipment	-	LU
Cellular Italia SpA	Variable	16/09/2013	16/09/2018	EUR	56.000.000	56.000.000	475	4,851%	-	Design, Manufacturing & Distribution	-	IT
Exterior Media UK Ltd	Variable	18/09/2013	18/03/2018	EUR	-	75.000.000	625	7,223%	-	Advertising & Marketing	-	GB
Noa Visual Group SLU	Variable	25/09/2013	31/07/2018	EUR	10.000.000	10.000.000	500	5,085%	-	Consumer Services	-	ES
Befesa Medio Ambiente SA	Variable	27/09/2013	27/06/2018	EUR	75.000.000	75.000.000	425	4,640%	-	Waste & Environment Services & Equipment	-	ES
Befesa Medio Ambiente SA	Variable	27/09/2013	27/06/2018	EUR	60.000.000	60.000.000	475	4,861%	-	Waste & Environment Services & Equipment	-	ES
Senoble SASU	Variable	14/10/2013	14/10/2018	EUR	-	12.500.000	350	4,526%	-	Food & Beverage	-	FR
Senoble SASU	Variable	14/10/2013	14/10/2018	EUR	-	116.100.000	350	4,526%	-	Food & Beverage	-	FR
Senoble SASU	Variable	14/10/2013	14/10/2018	EUR	-	23.400.000	350	4,526%	-	Food & Beverage	-	FR
Senoble SASU	Variable	14/10/2013	14/10/2018	EUR	-	20.000.000	365	4,764%	-	Food & Beverage	-	FR
Senoble SASU	Variable	14/10/2013	14/10/2018	EUR	-	10.000.000	350	4,526%	-	Food & Beverage	-	FR
Senoble SASU	Variable	14/10/2013	14/10/2018	EUR	-	30.000.000	350	4,526%	-	Food & Beverage	-	FR
Tarkett SA	Variable	14/10/2013	14/10/2018	EUR	246.000.000	246.000.000	175	2,314%	-	Home Improvement	-	FR
Tarkett SA	Variable	14/10/2013	14/10/2018	EUR	114.000.000	114.000.000	175	2,314%	-	Home Improvement	-	FR
Gas Natural SDG SA	Variable	28/10/2013	28/12/2018	EUR	750.000.000	750.000.000	160	1,937%	-	Utilities	-	ES
Enaitinere SLU	Variable	31/10/2013	31/10/2018	EUR	-	1.176.240.000	300	3,402%	-	Industrial Other	-	ES
Kirovo-Chepetsky Khimichesky Kombinat OJSC	Variable	18/11/2013	18/11/2018	EUR	148.093.000	148.093.000	250	3,456%	-	Chemicals	-	RU
Native Instruments GmbH	Variable	22/11/2013	01/10/2018	EUR	9.200.000	9.200.000	255	2,773%	-	Software & Services	-	DE
Altra Industrial Motion Netherlands BV	Variable	06/12/2013	06/12/2018	EUR	43.750.000	50.000.000	163	2,621%	-	Machinery Manufacturing	-	NL
EEW Energy from Waste GmbH	Variable	10/12/2013	21/03/2019	EUR	162.500.000	162.500.000	350	3,694%	-	Power Generation	-	DE
CARMILA SAS	Variable	15/12/2013	14/12/2018	EUR	1.050.000.000	1.050.000.000	150	2,052%	-	Real Estate	-	FR
Prime Office REIT-AG	Variable	18/12/2013	18/12/2018	EUR	225.000.000	225.000.000	190	2,394%	-	Real Estate	-	DE
Crown European Holdings SA	Variable	19/12/2013	19/12/2018	EUR	590.000.000	590.000.000	175	2,090%	-	Containers & Packaging	-	FR

Crown European Holdings SA	Variable	19/12/2013	19/12/2018	EUR	110.000.000	110.000.000	175	2,107%	BBB-	Containers & Packaging	-	FR
Tarkett SA	Variable	20/12/2013	14/10/2018	EUR	90.000.000	90.000.000	175	2,416%	-	Home Improvement	-	FR
Cargus International Srl	Variable	23/12/2013	23/12/2018	EUR	-	5.400.000	395	4,581%	-	Transportation & Logistics	-	RO
ATU Auto-Teile-Unger Handels GmbH & Co KG	Variable	24/01/2014	24/01/2019	EUR	50.000.000	50.000.000	950	9,135%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	DE
EuropaCorp	Variable	30/01/2014	30/01/2019	EUR	20.720.000	20.720.000	350	4,779%	-	Entertainment Content	-	FR
Le Cap	Variable	30/01/2014	29/06/2018	EUR	19.300.000	19.300.000	325	3,888%	-	Real Estate	-	FR
Camaieu International SAS	Variable	20/02/2014	22/05/2019	EUR	-	91.662.000	450	5,717%	-	Apparel & Textile Products	-	FR
Camaieu International SAS	Variable	20/02/2014	22/05/2019	EUR	-	50.337.000	450	5,717%	-	Apparel & Textile Products	-	FR
Camaieu International SAS	Variable	20/02/2014	22/05/2019	EUR	-	42.435.000	450	5,717%	-	Apparel & Textile Products	-	FR
Vocento SA	Variable	21/02/2014	21/10/2018	EUR	75.000.000	75.000.000	475	4,825%	-	Publishing & Broadcasting	-	ES
Vocento SA	Variable	21/02/2014	21/02/2019	EUR	55.000.000	55.000.000	350	4,383%	-	Publishing & Broadcasting	-	ES
Hibu plc	Variable	03/03/2014	03/03/2019	EUR	145.966.000	145.966.000	500	5,104%	-	Advertising & Marketing	-	GB
Oberthur Technologies SA	Variable	12/03/2014	18/10/2019	EUR	260.000.000	260.000.000	375	4,633%	B-	Software & Services	-	FR
Kaufman & Broad SA	Variable	14/03/2014	19/03/2019	EUR	50.000.000	50.000.000	350	4,598%	-	Homebuilders	-	FR
Kaufman & Broad SA	Variable	14/03/2014	19/03/2019	EUR	100.000.000	100.000.000	325	4,324%	-	Homebuilders	-	FR
Linxens France SA	Variable	03/04/2014	21/10/2018	EUR	-	200.000.000	400	4,038%	-	Hardware	-	FR
eircom Finco Sarl	Variable	04/04/2014	30/09/2019	EUR	158.834.000	158.834.000	450	4,663%	-	Wireline Telecommunications Services	-	LU
Stahl Holdings BV	Variable	08/04/2014	08/07/2019	EUR	96.900.000	130.000.000	350	4,254%	-	Chemicals	-	NL
Beni Stabili SpA SIIQ	Variable	16/04/2014	16/04/2019	EUR	60.000.000	60.000.000	250	3,373%	-	Real Estate	-	IT
Societe Fonciere Lyonnaise SA	Variable	30/04/2014	23/04/2019	EUR	50.000.000	50.000.000	165	2,062%	-	Real Estate	-	FR
Inter Media Communication Srl	Variable	27/05/2014	05/06/2019	EUR	230.000.000	230.000.000	550	5,560%	-	Consumer Services	-	IT
IMCD Group NV	Variable	03/06/2014	03/07/2019	EUR	240.544.000	240.544.000	175	2,308%	-	Chemicals	-	NL
Parques Reunidos Servicios Centrales SAU	Variable	04/06/2014	26/03/2019	EUR	297.454.000	297.454.000	500	4,711%	-	Entertainment Resources	-	ES
Parques Reunidos Servicios Centrales SAU	Variable	04/06/2014	29/09/2019	EUR	119.000.000	119.000.000	650	6,790%	-	Entertainment Resources	-	ES
Parques Reunidos Servicios Centrales SAU	Variable	04/06/2014	26/03/2019	EUR	350.634.000	350.634.000	500	4,710%	-	Entertainment Resources	-	ES
Parques Reunidos Servicios Centrales SAU	Variable	04/06/2014	26/03/2019	EUR	-	1.000.000	500	4,711%	-	Entertainment Resources	-	ES
Tokheim Group SAS	Variable	17/06/2014	14/06/2019	EUR	90.000.000	90.000.000	450	5,133%	-	Machinery Manufacturing	-	FR
ComCave Holding GmbH	Variable	24/06/2014	24/06/2019	EUR	-	33.000.000	375	4,816%	-	Educational Services	-	DE
Deutsche Raststätten Holding GmbH	Variable	26/06/2014	10/12/2019	EUR	625.000.000	625.000.000	350	3,246%	BB	Retail - Consumer Discretionary	-	DE

Grupo Ferrer Internacional SA	Variable	26/06/2014	26/06/2019	EUR	150.000.000	150.000.000	325	4,682%	-	Pharmaceuticals	-	ES
Mediq BV	Variable	27/06/2014	27/03/2019	EUR	-	50.000.000	375	3,836%	-	Health Care Facilities & Services	-	NL
Mediq BV	Variable	27/06/2014	27/02/2020	EUR	465.000.000	465.000.000	400	3,843%	-	Health Care Facilities & Services	-	NL
Mediq BV	Variable	27/06/2014	27/03/2019	EUR	138.000.000	138.000.000	375	3,891%	-	Health Care Facilities & Services	-	NL
Amor Group/The	Variable	30/06/2014	30/06/2019	EUR	5.000.000	5.000.000	375	4,350%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	DE
Amor Group/The	Variable	30/06/2014	30/06/2019	EUR	25.000.000	25.000.000	375	4,350%	-	Retail - Consumer Discretionary	-	DE
DE Master Blenders 1753 NV	Variable	30/06/2014	23/07/2019	EUR	2.900.000.000	2.900.000.000	300	2,943%	BB	Food & Beverage	-	NL
DE Master Blenders 1753 NV	Variable	30/06/2014	23/07/2019	EUR	1.000.000.000	1.000.000.000	300	3,395%	BB	Food & Beverage	-	NL
Parc Logistic de La Zona Franca SA	Variable	30/06/2014	30/06/2019	EUR	36.000.000	36.000.000	275	3,757%	-	Real Estate	-	ES
Gallerie Commerciali Joint Venture	Variable	01/07/2014	24/07/2019	EUR	-	11.200.000	120	2,376%	-	Real Estate	-	IT
Infront Sports & Media AG	Variable	18/07/2014	01/06/2019	EUR	-	70.000.000	500	5,192%	-	Advertising & Marketing	99,500	CH
Infront Sports & Media AG	Variable	18/07/2014	01/06/2020	EUR	-	85.000.000	800	7,991%	-	Advertising & Marketing	98,500	CH
Xfera Moviles SA	Variable	18/07/2014	18/07/2019	EUR	130.000.000	130.000.000	300	4,410%	-	Wireless Telecommunications Services	-	ES
Hines Italia Sgr SpA-Porta Nuova Garibaldi	Variable	21/07/2014	21/07/2019	EUR	445.978.000	445.978.000	215	2,391%	-	Real Estate	-	IT
Logicor Husarian I Sp zoo	Variable	22/07/2014	22/07/2019	EUR	92.343.400	92.343.400	238	3,331%	-	Real Estate	-	PL
Logicor Husarian I Sp zoo	Variable	22/07/2014	22/07/2019	EUR	81.811.000	81.811.000	238	3,331%	-	Real Estate	-	PL
Fondo Antirion Retail Multicomparto	Variable	24/07/2014	24/07/2019	EUR	86.000.000	86.000.000	195	2,471%	-	Real Estate	-	IT
Sealed Air BV	Variable	25/07/2014	25/07/2019	EUR	147.875.000	147.875.000	175	2,174%	-	Chemicals	-	NL
Ingenico Group	Variable	29/07/2014	29/07/2019	EUR	100.000.000	100.000.000	160	1,853%	-	Hardware	-	FR
Clinicas Del Sur SL	Variable	31/07/2014	31/07/2019	EUR	44.300.000	44.300.000	275	3,657%	-	Health Care Facilities & Services	-	ES
Eroski S Coop	Variable	01/08/2014	31/07/2019	EUR	948.000.000	948.000.000	375	4,704%	-	Supermarkets & Pharmacies	-	ES
GIP II Palma Luxco II Sarl	Variable	01/08/2014	01/08/2019	EUR	162.500.000	162.500.000	250	3,556%	-	Chemicals	-	LU
URO Property Holdings SL	Variable	01/08/2014	22/11/2019	EUR	1.450.000.000	1.450.000.000	300	3,682%	-	Financial Services	-	ES
DLK Acquisitions BV	Variable	06/08/2014	06/02/2019	EUR	-	310.000.000	425	4,400%	B	Utilities	99,000	NL
DLK Acquisitions BV	Variable	06/08/2014	06/08/2019	EUR	-	100.000.000	750	9,227%	CCC+	Utilities	99,000	NL
Huvepharma AD	Variable	15/08/2014	15/08/2019	EUR	75.000.000	75.000.000	350	3,214%	BB-	Pharmaceuticals	-	BG
Elis SA	Variable	02/09/2014	02/09/2019	EUR	650.000.000	650.000.000	263	2,536%	BB	Consumer Services	-	FR
ZF Friedrichshafen AG	Variable	06/10/2014	06/10/2019	EUR	0	612.000.000	275	4,013%	-	Auto Parts Manufacturing	-	DE
RHI AG	Variable	08/10/2014	08/10/2019	EUR	170.000.000	170.000.000	100	2,499%	-	Metals & Mining	-	AT
Grupo de Empresas Azvi SL	Variable	09/10/2014	09/10/2019	EUR	78.719.100	78.719.100	450	5,140%	-	Industrial Other	-	ES

Grupo de Empresas Azvi SL	Variable	09/10/2014	09/10/2019	EUR	9.500.000	9.500.000	450	5,140%	-	Industrial Other	-	ES
MCE OPCO	Variable	13/10/2014	13/10/2019	EUR	43.000.000	43.000.000	220	2,999%	-	Travel & Lodging	-	FR
Splendid Propco SCI	Variable	13/10/2014	13/10/2019	EUR	132.000.000	132.000.000	220	2,999%	-	Real Estate	-	FR
Vivarte SAS	Variable	20/10/2014	29/10/2019	EUR	500.000.000	500.000.000	400	11,328%	CCC+	Apparel & Textile Products	99,000	FR
Schaeffler Verwaltungs GmbH	Variable	21/10/2014	21/10/2019	EUR	500.000.000	500.000.000	450	5,084%	-	Auto Parts Manufacturing	-	DE
SPCM SA	Variable	21/10/2014	21/10/2019	EUR	80.000.000	80.000.000	225	3,207%	-	Chemicals	-	FR
Osborne Distribuidora SA	Variable	22/10/2014	25/07/2020	EUR	15.000.000	15.000.000	250	3,252%	-	Distributors - Consumer Discret.	-	ES
INA Beteiligungsgesellschaft mbH	Variable	27/10/2014	15/05/2020	EUR	750.000.000	750.000.000	350	4,062%	BB-	Auto Parts Manufacturing	99,500	DE
Styrolution Group GmbH	Variable	07/11/2014	30/09/2019	EUR	525.000.000	525.000.000	550	6,412%	B	Chemicals	98,000	DE
Ontex Group NV	Variable	10/11/2014	10/11/2019	EUR	380.000.000	380.000.000	275	2,814%	BB-	Consumer Products	-	BE
BARTEC Top Holding GmbH	Variable	14/11/2014	30/09/2019	EUR	-	95.000.000	450	4,610%	-	Electrical Equipment Manufacturing	99,500	DE
Amdipharm Mercury Debtco Ltd	Variable	21/11/2014	13/12/2019	EUR	449.187.000	449.187.000	475	4,674%	B+	Financial Services	99,500	GB
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Variable	26/11/2014	30/10/2019	EUR	282.000.000	300.000.000	138	1,790%	BBB-	Health Care Facilities & Services	-	DE
Famosa SA	Variable	05/12/2014	05/12/2019	EUR	20.000.000	20.000.000	325	4,383%	-	Leisure Products Manufacturing	-	ES
Perrigo Finance plc	Variable	05/12/2014	05/12/2019	EUR	-	300.000.000	150	2,282%	-	Pharmaceuticals	-	IE
Perrigo Finance plc	Variable	05/12/2014	05/12/2019	EUR	462.500.000	500.000.000	150	2,430%	-	Pharmaceuticals	-	IE
Park Tower Investments Ltd	Variable	16/12/2014	16/12/2019	EUR	17.000.000	17.000.000	920	8,564%	-	Entertainment Resources	-	GB
Park Tower Investments Ltd	Variable	16/12/2014	16/12/2019	EUR	133.000.000	133.000.000	220	2,997%	-	Entertainment Resources	-	GB
Tata Steel UK Holdings Ltd	Variable	17/12/2014	16/10/2019	EUR	370.000.000	370.000.000	315	4,242%	-	Metals & Mining	-	GB
AGCO International Holdings BV	Variable	18/12/2014	15/01/2020	EUR	200.000.000	200.000.000	58	1,415%	-	Machinery Manufacturing	-	NL
SPIE SA	Variable	18/12/2014	31/08/2019	EUR	625.000.000	625.000.000	425	4,224%	NR	Industrial Other	99,000	FR
Tradebe Management Ltd	Variable	18/12/2014	22/12/2019	EUR	187.744.000	187.744.000	325	4,190%	-	Waste & Environment Services & E.	-	GB
Servus Luxembourg Holding SCA	Variable	19/12/2014	19/06/2020	EUR	270.000.000	270.000.000	200	3,132%	-	Auto Parts Manufacturing	-	LU
Kennedy Wilson Europe Real Estate Plc	Variable	31/12/2014	31/12/2019	EUR	264.000.000	264.000.000	213	2,489%	-	Real Estate	-	GB

**ANEXO II. Tipos de interés de la DEUDA contratada en el periodo 2011-2014 en los mercados europeo y español
Emisión de Bonos en España en el año 2011– Fuente Bloomberg**

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
Amadeus Capital Markets SA	4,875%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	1.061.100.000	1.061.100.000	-	0,342%	BBB	Software & Services	99,493	ES
Autonomous Community of Madrid Spain	6,213%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	919.502.724	919.502.724	-	0,216%	BBB	Government Local	-	ES
Autonomous Community of Madrid Spain	5,650%	11/03/2011	11/03/2016	EUR	126.288.890	126.288.890	-	0,277%	-	Government Local	100,000	ES
Autonomous Community of Valencia Spain	7,875%	22/07/2011	22/07/2016	EUR	287.300.000	287.300.000	-	0,995%	BB	Government Local	-	ES
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4,750%	10/02/2011	10/02/2016	EUR	2.725.200.000	2.725.200.000	-	0,078%	A	Banks	99,344	ES
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4,000%	16/09/2011	16/09/2016	EUR	74.505.960	74.505.960	-	0,347%	-	Banks	100,000	ES
Banco Espanol de Credito SA	4,080%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	689.957.400	689.957.400	-	0,342%	BBB+	Banks	100,000	ES
Banco Pastor SA	5,800%	16/12/2011	16/12/2016	EUR	0	650.600.000	-	0,687%	-	Banks	100,000	
Banco Santander SA	4,625%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	1.439.760.000	1.439.760.000	-	0,149%	-	Diversified Banks	99,485	ES
Banco Santander SA	4,625%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	1.346.900.000	1.346.900.000	-	0,069%	-	Diversified Banks	99,481	ES
BBVA Senior Finance SAU	4,875%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	873.680.500	873.680.500	-	0,258%	BBB	Banks	99,831	ES
BFA Sociedad Tenedora de Acciones SAU	5,250%	07/04/2011	07/04/2016	EUR	2.416.531.000	2.416.531.000	-	0,260%	BBB	Banks	99,777	ES
BFA Sociedad Tenedora de Acciones SAU	5,375%	05/05/2011	05/05/2016	EUR	173.452.020	173.452.020	-	0,671%	-	Banks	-	ES
CaixaBank SA	5,000%	22/02/2011	22/02/2016	EUR	3.004.804.000	3.004.804.000	-	0,145%	A	Banks	99,508	ES
CaixaBank SA	5,125%	27/04/2011	27/04/2016	EUR	1.835.625.000	1.835.625.000	-	0,145%	A	Banks	99,927	ES
CaixaBank SA	5,362%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	14.190.000	14.190.000	-	0,590%	-	Banks	100,000	ES
Caja de Ahorros de Murcia	5,050%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	14.187.700	14.187.700	-	0,823%	-	Banks	100,000	ES
Cajas Rurales Unidas SCC	5,000%	20/12/2011	20/12/2016	EUR	654.355.000	654.355.000	-	0,361%	BBB+	Banks	100,000	ES
Comunidad Autonoma de Aragon	5,900%	11/02/2011	11/02/2016	EUR	187.939.120	187.939.120	-	0,232%	BBB	Government Regional	-	ES
Comunidad Autonoma de Canarias	2,000%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	272.268.000	272.268.000	-	0,536%	-	Government Local	100,000	ES
Comunidad Autonoma de Canarias	2,000%	23/12/2011	23/12/2016	EUR	22.065.147	22.065.147	-	0,968%	-	Government Local	-	ES
Comunidad Foral de Navarra	5,529%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	281.336.400	281.336.400	-	0,290%	-	Government Local	100,000	ES
Comunidad Foral de Navarra	5,250%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	48.919.500	48.919.500	-	0,335%	A-	Government Local	100,000	ES
Fondo de Reestructuración Ordenada Bancaria	5,500%	12/07/2011	12/07/2016	EUR	3.509.254.500	3.509.254.500	-	0,138%	BBB	Government Agencies	99,889	ES
Instituto de Credito Oficial	5,125%	25/01/2011	25/01/2016	EUR	4.740.525.500	4.774.630.000	-	0,089%	BBB	Government Agencies	99,897	ES
Instituto de Credito Oficial	4,930%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	335.448.000	335.448.000	-	2,591%	BBB	Government Agencies	100,000	ES

Junta de Castilla y Leon	4,750%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	85.201.800	85.201.800	-	0,282%	-	Government Regional	100,000	ES
Junta de Extremadura	6,612%	27/05/2011	27/05/2016	EUR	7.159.350	7.159.350	-	0,533%	-	Government Regional	-	ES
Kutxabank SA	4,400%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	646.488.150	646.488.150	-	0,480%	-	Banks	100,000	ES
Sacyr SA	6,500%	12/04/2011	01/05/2016	EUR	289.690.000	289.690.000	-	4,251%	-	Industrial Other	100,000	ES
Unicaja Banco SA	5,500%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	706.200.000	706.200.000	-	0,177%	-	Banks	99,927	ES
Xunta de Galicia	3,584%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	99.498.000	99.498.000	203,75	2,016%	BBB	Government Regional	-	ES

Emisión de Bonos en España en el año 2012– Fuente Bloomberg

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
Abanca Corporacion Bancaria SA	3,945%	30/04/2012	30/04/2017	EUR	1.844.136.540	1.844.136.540	89,63	0,874%	-	Banks	100,000	ES
Autonomous Community of Madrid Spain	5,500%	14/02/2012	14/02/2017	EUR	1.161.205.360	1.161.205.360	-	0,348%	BBB	Government Local	-	ES
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	3,500%	05/12/2012	05/12/2017	EUR	2.617.180.000	2.617.180.000	-	0,094%	-	Banks	100,000	ES
Banco CAM SAU	4,500%	09/03/2012	09/03/2017	EUR	1.397.045.700	1.574.136.000	-	4,655%	-	Banks	99,759	ES
Banco Cooperativo Espanol SA	2,485%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	1.187.064.200	1.187.064.200	55,96	0,538%	-	Banks	100,000	ES
Banco de Valencia SA	4,000%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	0	1.615.500.000	-	0,358%	-	Banks	-	ES
Banco Popular Espanol SA	4,125%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	1.333.240.000	1.333.240.000	-	0,139%	-	Banks	99,580	ES
Bankinter SA	4,125%	22/03/2012	22/03/2017	EUR	1.318.340.000	1.318.340.000	-	0,134%	A	Banks	99,721	ES
Bankinter SA	3,989%	20/11/2012	20/11/2017	EUR	768.360.000	768.360.000	15,15	0,129%	A	Banks	100,000	ES
Cabildo Insular Gran Canaria	2,000%	26/11/2012	26/11/2017	EUR	27.580.408	27.580.408	-	1,073%	-	Government Regional	-	ES
CaixaBank SA	4,000%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	1.310.380.000	1.310.380.000	-	0,094%	A	Banks	99,530	ES
CaixaBank SA	6,500%	25/01/2012	25/01/2017	EUR	0	1.304.780.000	-	0,411%	A	Banks	100,000	ES
CaixaBank SA	6,500%	01/02/2012	01/02/2017	EUR	329.600.000	329.600.000	-	0,270%	NR	Banks	100,000	ES
Cajas Rurales Unidas SCC	5,500%	03/07/2012	03/07/2017	EUR	945.870.000	945.870.000	-	0,373%	BBB+	Banks	100,000	ES
Cajas Rurales Unidas SCC	5,000%	14/02/2012	14/02/2017	EUR	426.335.000	426.335.000	-	0,366%	-	Banks	100,000	ES
Comunidad Autonoma de Canarias	2,000%	03/12/2012	03/12/2017	EUR	66.979.704	66.979.704	-	1,209%	-	Government Local	100,000	ES
Enagas Financiaciones SAU	4,250%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	610.442.040	978.900.000	-	0,375%	BBB+	Utilities	99,801	ES
Instituto de Credito Oficial	4,625%	25/01/2012	31/01/2017	EUR	4.292.726.200	4.371.013.000	-	0,183%	BBB	Government Agencies	99,465	ES
Liberbank SA	4,486%	19/12/2012	19/12/2017	EUR	1.324.470.000	1.324.470.000	17,93	0,157%	-	Banks	-	ES
Rural Cedula I FTA	4,000%	13/03/2012	13/03/2017	EUR	1.311.050.000	1.311.050.000	-	0,258%	-	Financial Services	100,000	ES
Santander International Debt SAU	4,000%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	1.493.033.332	1.493.033.332	-	0,508%	BBB+	Financial Services	99,951	ES
Telefonica Emisiones SAU	5,811%	19/09/2012	05/09/2017	EUR	1.306.890.000	1.306.890.000	-	0,495%	BBB	Wireline Telecommunications Services	100,000	ES
Unicaja Banco SA	4,203%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	933.646.000	933.646.000	-	0,156%	-	Banks	100,000	ES
Unicaja Banco SA	6,900%	20/06/2012	20/06/2017	EUR	380.769.000	380.769.000	-	0,501%	-	Banks	100,000	ES
Unicaja Banco SA	6,250%	23/05/2012	23/05/2017	EUR	376.812.000	376.812.000	-	0,501%	-	Banks	100,000	ES
Xunta de Galicia	6,964%	28/12/2012	28/12/2017	EUR	97.843.540	97.843.540	-	0,600%	-	Government Regional	-	ES

Emisión de Bonos en España en el año 2013– Fuente Bloomberg

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
Abengoa Finance SAU	8,875%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	747.120.000	747.120.000	-	11,535%	B+	Industrial Other	100,000	ES
Abengoa Finance SAU	8,875%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	747.120.000	747.120.000	-	9,547%	B+	Industrial Other	100,000	ES
Autonomous Community of Madrid Spain	5,750%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	1.413.622.760	1.413.622.760	-	0,593%	BBB	Government Local	99,683	ES
Banco de Sabadell SA	3,375%	23/01/2013	23/01/2018	EUR	1.330.740.000	1.330.740.000	-	0,181%	-	Banks	99,508	ES
Banco Santander SA	2,875%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	2.714.740.000	2.714.740.000	-	0,122%	-	Diversified Banks	99,487	ES
Bankinter SA	3,125%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	801.456.000	801.456.000	-	0,210%	A	Banks	99,668	ES
BBVA Senior Finance SAU	3,750%	17/01/2013	17/01/2018	EUR	2.004.585.000	2.004.585.000	-	0,525%	BBB	Banks	99,709	ES
Cabildo Insular Gran Canaria	1,750%	04/12/2013	04/12/2018	EUR	32.839.992	32.839.992	-	1,275%	-	Government Regional	-	ES
CaixaBank SA	3,125%	14/05/2013	14/05/2018	EUR	1.295.360.000	1.295.360.000	-	0,699%	BBB	Banks	99,708	ES
CaixaBank SA	3,000%	22/03/2013	22/03/2018	EUR	1.297.380.000	2.594.760.000	-	0,189%	A	Banks	99,858	ES
CaixaBank SA	3,964%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	407.211.000	407.211.000	-	0,647%	-	Banks	100,000	ES
CaixaBank SA	3,000%	07/06/2013	07/06/2018	EUR	1.718.808.000	1.718.808.000	-	0,158%	-	Banks	99,748	ES
Caja Rural de Granada S Coop de Credito	3,000%	16/12/2013	16/12/2018	EUR	824.760.000	824.760.000	-	0,292%	-	Banks	100,000	ES
Caja Rural de Navarra	2,875%	11/06/2013	11/06/2018	EUR	663.895.000	663.895.000	-	0,199%	-	Banks	99,624	ES
Cajas Rurales Unidas SCC	3,750%	22/11/2013	22/11/2018	EUR	1.015.387.500	1.015.387.500	-	0,505%	BBB+	Banks	-	ES
Comunidad Autonoma de Aragon	4,000%	20/09/2013	20/09/2018	EUR	231.303.150	231.303.150	-	0,763%	-	Government Regional	-	ES
Ferrovial Emisiones SA	3,375%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	678.685.000	678.685.000	-	0,640%	BBB	Industrial Other	99,692	ES
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	3,875%	21/03/2013	17/03/2018	EUR	2.356.531.250	2.356.531.250	-	0,465%	BBB	Government Agencies	99,800	ES
Indra Sistemas SA	1,750%	17/10/2013	17/10/2018	EUR	341.560.000	341.560.000	-	1,691%	-	Software & Services	-	ES
Junta de Castilla y Leon	6,270%	18/01/2013	19/02/2018	EUR	366.319.250	366.319.250	-	0,566%	-	Government Regional	-	ES
Junta de Extremadura	6,125%	12/02/2013	12/02/2018	EUR	26.925.600	26.925.600	-	0,626%	-	Government Regional	-	ES
Prosegur Cia de Seguridad SA	2,750%	02/04/2013	02/04/2018	EUR	641.305.000	641.305.000	-	0,816%	BBB	Consumer Services	99,627	ES
SA de Obras y Servicios COPASA	7,500%	19/12/2013	19/12/2018	EUR	68.326.000	68.326.000	-	7,804%	-	Industrial Other	100,000	ES

Emisión de Bonos en España en el año 2014– Fuente Bloomberg

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
Abengoa Greenfield SA	5,500%	30/09/2014	01/10/2019	EUR	334.660.550	334.660.550	-	13,484%	B+	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	ES
Abengoa Greenfield SA	5,500%	30/09/2014	01/10/2019	EUR	334.660.550	334.660.550	-	13,526%	B+	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	ES
Acciona SA	4,625%	22/07/2014	22/07/2019	EUR	179.111.100	179.111.100	-	4,501%	-	Industrial Other	99,455	ES
Autopista Concesionaria Astur Leonesa SA	4,350%	09/06/2014	09/06/2019	EUR	311.665.134	311.665.134	-	4,242%	-	Transportation & Logistics	100,000	ES
Banco de Sabadell SA	0,835%	27/06/2014	27/06/2019	EUR	27.282.200	27.282.200	71,80	0,696%	-	Banks	98,500	ES
Banco de Sabadell SA	0,936%	18/03/2014	18/03/2019	EUR	6.960.950	6.960.950	131,55	1,294%	-	Banks	98,500	ES
Banco de Sabadell SA	0,691%	13/05/2014	13/05/2019	EUR	27.399.400	27.399.400	145,48	0,980%	-	Banks	98,500	ES
Banco de Sabadell SA	1,236%	18/03/2014	18/03/2019	EUR	16.010.185	16.010.185	156,28	1,541%	-	Banks	100,000	ES
Banco Mare Nostrum SA	3,125%	21/01/2014	21/01/2019	EUR	677.515.000	677.515.000	-	0,315%	-	Banks	99,872	ES
Bankia SA	3,500%	17/01/2014	17/01/2019	EUR	1.353.180.000	1.353.180.000	-	1,775%	BB	Diversified Banks	-	ES
Bankinter SA	1,750%	10/06/2014	10/06/2019	EUR	677.290.000	677.290.000	-	0,889%	BBB-	Banks	-	ES
BBVA Senior Finance SAU	2,375%	22/01/2014	22/01/2019	EUR	1.355.100.000	1.355.100.000	-	0,704%	BBB	Banks	99,749	ES
Cabildo Insular Gran Canaria	0,500%	10/12/2014	10/12/2019	EUR	65.868.400	65.868.400	-	1,482%	-	Government Regional	-	ES
Comunidad Autonoma de Aragon	2,875%	10/02/2014	10/02/2019	EUR	852.612.500	852.612.500	-	0,884%	-	Government Regional	-	ES
Comunidad Autonoma de Canarias	0,500%	18/12/2014	18/12/2019	EUR	61.419.000	61.419.000	-	1,470%	-	Government Local	100,000	ES
Criteria CaixaHolding SA	2,375%	09/05/2014	09/05/2019	EUR	1.375.810.000	1.375.810.000	-	1,406%	-	Financial Services	99,577	ES
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	1,500%	22/07/2014	22/07/2019	EUR	673.350.000	673.350.000	-	1,133%	BBB-	Supermarkets & Pharmacies	99,419	ES
Emisora Santander Espana SAU	1,700%	27/05/2014	27/05/2019	EUR	136.160.000	136.160.000	-	0,849%	-	Banks	100,000	ES
Ortiz Construcciones y Proyetos SA	7,000%	03/07/2014	03/07/2019	EUR	68.013.500	68.013.500	-	8,670%	-	Industrial Other	100,000	ES
Sacyr SA	4,000%	08/05/2014	08/05/2019	EUR	346.530.000	346.530.000	-	6,698%	-	Industrial Other	100,000	ES
Telecomunicaciones y Energia	6,500%	08/04/2014	08/04/2019	EUR	48.285.650	48.285.650	-	6,310%	-	Software & Services	100,000	ES

Emisión de Bonos en Europa en el año 2011– Fuente Bloomberg

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
Aareal Bank AG	3,000%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	43.902.000	43.902.000	34,61	0,324%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	3,548%	23/12/2011	23/12/2016	EUR	271.571.040	271.571.040	21,92	0,267%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	2,250%	02/09/2011	02/09/2016	EUR	14.203.000	14.203.000	40,99	0,388%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,828%	24/11/2011	24/11/2016	EUR	26.680.400	26.680.400	23,47	0,213%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,436%	23/09/2011	23/09/2016	EUR	13.469.500	13.469.500	25,79	0,236%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	2,750%	09/03/2011	09/03/2016	EUR	13.900.000	13.900.000	38,99	0,368%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	2,750%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	14.510.400	14.510.400	41,41	0,392%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	2,750%	01/08/2011	01/08/2016	EUR	7.119.350	7.119.350	44,10	0,419%	-	Financial Services	100,000	DE
Abbey National Treasury Services PLC/London	3,625%	08/09/2011	08/09/2016	EUR	1.828.561.875	1.828.561.875	-	0,032%	AAA	Banks	99,996	GB
Abbey National Treasury Services PLC/London	3,000%	17/01/2011	17/01/2016	EUR	3.988.500	3.988.500	59,08	0,569%	-	Banks	100,000	GB
Abbey National Treasury Services PLC/London	2,000%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	69.820.000	69.820.000	44,02	0,418%	-	Banks	100,000	GB
ABN AMRO Bank NV	4,250%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	2.166.000.000	2.166.000.000	-	0,137%	A	Banks	99,907	NL
ABN AMRO Bank NV	3,000%	05/05/2011	05/05/2016	EUR	145.758.000	145.758.000	62,24	0,600%	-	Banks	100,000	NL
ABN AMRO Bank NV	1,986%	16/12/2011	16/12/2016	EUR	39.036.000	39.036.000	45,08	0,429%	-	Banks	100,000	NL
ABN AMRO Bank NV	4,950%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	7.247.850	7.247.850	-	0,586%	-	Banks	100,000	NL
ABN AMRO Bank NV	2,800%	30/03/2011	30/03/2016	EUR	706.300	706.300	53,13	0,509%	-	Banks	100,000	NL
ABN AMRO Bank NV	3,000%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	5.405.513	5.405.513	52,15	0,499%	-	Banks	100,000	NL
ABN AMRO Bank NV	3,300%	04/04/2011	04/04/2016	EUR	7.107.750	7.107.750	49,63	0,474%	-	Banks	100,000	NL
Aktia Hypoteksbank Abp	3,125%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	864.882.000	864.882.000	-	0,002%	-	Consumer Finance	99,590	FI
ALBIS Leasing AG	7,625%	04/10/2011	04/10/2016	EUR	66.370.000	66.370.000	-	5,339%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Allgemeine Sparkasse Oberoesterreich Bank AG	3,500%	10/02/2011	10/02/2016	EUR	40.878.000	40.878.000	-	0,997%	-	Banks	100,250	AT
Allgemeine Sparkasse Oberoesterreich Bank AG	2,750%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	41.599.500	41.599.500	-	1,029%	-	Banks	100,000	AT
Allgemeine Sparkasse Oberoesterreich Bank AG	2,900%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	13.517.900	13.517.900	-	1,029%	-	Banks	100,000	AT
Allgemeine Sparkasse Oberoesterreich Bank AG	0,686%	26/09/2011	26/09/2016	EUR	40.382.700	40.382.700	109,85	1,146%	-	Banks	100,000	AT
Amadeus Capital Markets SA	4,875%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	1.061.100.000	1.061.100.000	-	0,347%	BBB	Software & Services	99,493	ES
Asset Banca SpA	4,250%	28/03/2011	28/03/2016	EUR	14.097.000	14.097.000	-	1,900%	-	Banks	100,000	SM
Austria Technologie & Systemtechnik AG	5,000%	18/11/2011	18/11/2016	EUR	135.140.000	135.140.000	-	1,715%	-	Hardware	100,849	AT

Austrian Anadi Bank AG	0,277%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	14.850.600	14.850.600	20,54	0,183%	-	Consumer Finance	100,000	AT
Autonomous Community of Madrid Spain	5,650%	11/03/2011	11/03/2016	EUR	126.288.890	126.288.890	-	0,277%	-	Government Local	100,000	ES
AXA Belgium Finance NL BV	4,500%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	707.400.000	707.400.000	-	0,581%	-	Life Insurance	100,000	NL
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,000%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	7.100.150	7.100.150	-	1,257%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	2,500%	07/02/2011	07/02/2016	EUR	4.875.840	4.875.840	-	1,230%	-	Banks	100,000	IT
Banca Alpi Marittime Credito Cooperativo di Carru SCARL	3,000%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	21.660.000	21.660.000	132,85	1,306%	-	Banks	100,000	IT
Banca Apulia SpA	4,200%	22/07/2011	22/07/2016	EUR	28.730.000	28.730.000	-	3,033%	-	Banks	100,000	IT
Banca Apulia SpA	4,250%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	14.826.000	14.826.000	-	2,713%	-	Banks	100,000	IT
Banca Apulia SpA	0,568%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	14.826.000	14.826.000	276,57	2,814%	-	Banks	100,000	IT
Banca Apulia SpA	0,000%	18/11/2011	18/11/2016	EUR	9.367.905	9.367.905	-	3,408%	-	Banks	75,554	IT
Banca Apulia SpA	4,250%	22/07/2011	22/07/2016	EUR	7.182.500	7.182.500	-	3,083%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carime SpA	3,000%	28/02/2011	29/02/2016	EUR	41.376.300	41.376.300	-	0,588%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carime SpA	4,250%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	28.354.725	28.354.725	-	0,996%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carime SpA	3,000%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	13.134.187	13.134.187	-	0,762%	-	Banks	100,000	IT
Banca Caripe SpA	3,000%	23/05/2011	23/05/2016	EUR	21.165.403	21.165.403	249,33	2,541%	-	Banks	100,000	IT
Banca Caripe SpA	0,080%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	27.226.000	27.226.000	225,46	2,301%	-	Banks	96,250	IT
Banca Caripe SpA	2,359%	17/05/2011	17/05/2016	EUR	141.696.000	141.696.000	216,33	2,211%	-	Banks	100,000	IT
Banca Caripe SpA	3,400%	21/01/2011	21/01/2016	EUR	11.756.087	27.166.000	-	2,809%	-	Banks	100,000	IT
Banca Cassa di Risparmio di Savigliano SpA	3,500%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	6.988.500	6.988.500	-	1,203%	-	Banks	100,000	IT
Banca dei Due Mari di Calabria Credito Cooperativo	2,500%	05/01/2011	05/01/2016	EUR	11.258.282	11.258.282	-	2,795%	-	Banks	100,000	IT
Banca del Cilento e Lucania Sud SC	4,000%	25/01/2011	25/01/2016	EUR	1.549.708	9.549.260	-	2,982%	-	Banks	100,000	IT
Banca del Lavoro e del Piccolo Risparmio SpA	4,600%	13/06/2011	13/06/2016	EUR	7.180.850	7.180.850	-	2,397%	-	Banks	100,000	IT
Banca del Monte Lucca SpA	0,580%	12/08/2011	12/08/2016	EUR	119.574.000	119.574.000	45,62	0,504%	-	Banks	100,000	IT
Banca della Campania SpA	3,750%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	18.644.928	21.660.000	-	2,287%	-	Banks	100,000	IT
Banca della Campania SpA	3,200%	17/01/2011	17/01/2016	EUR	10.379.407	13.295.000	-	2,623%	-	Banks	100,000	IT
Banca della Campania SpA	4,500%	24/10/2011	24/10/2016	EUR	20.265.236	27.842.600	-	2,634%	-	Banks	100,000	IT
Banca della Marca Credito Cooperativo SC	4,300%	01/11/2011	01/11/2016	EUR	20.605.500	20.605.500	-	2,740%	-	Banks	100,000	IT
Banca della Nuova Terra SpA	1,098%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	139.770.000	139.770.000	111,76	1,166%	-	Banks	100,000	IT
Banca dell'Artigianato e dell'Industria SpA	3,500%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	13.649.200	13.649.200	-	2,503%	-	Banks	100,000	IT
Banca dell'Artigianato e dell'Industria SpA	4,000%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	7.210.750	7.210.750	-	2,890%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	4,000%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	14.214.000	14.214.000	-	2,901%	-	Banks	100,000	IT

Banca delle Marche SpA	3,750%	28/07/2011	28/07/2016	EUR	42.924.600	42.924.600	285,85	2,906%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	4,500%	26/05/2011	26/05/2016	EUR	7.064.800	7.064.800	-	2,976%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	2,500%	08/06/2011	08/06/2016	EUR	8.313.223	14.605.100	299,06	3,039%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	4,000%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	1.414.800	1.414.800	-	3,011%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	4,000%	16/08/2011	16/09/2016	EUR	1.656.587	7.202.550	-	3,048%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	4,500%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	9.807.660	14.214.000	-	2,914%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	3,750%	30/11/2011	30/11/2016	EUR	3.059.397	3.059.397	322,33	3,271%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Caraglio del Cuneese Riviera dei Fiori-Credito Cooperativo-Societa Coop	0,050%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	14.200.300	14.200.300	185,17	1,900%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Cesena Credito Cooperativo di Cesena e Ronta SC	3,100%	24/01/2011	24/01/2016	EUR	6.821.000	6.821.000	-	1,499%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Cividale SpA	3,250%	26/01/2011	26/01/2016	EUR	9.211.530	9.211.530	-	1,368%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Cernusco sul Naviglio SC	1,985%	10/10/2011	10/10/2016	EUR	13.661.000	13.661.000	122,88	1,207%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo del Polesine-Rovigo SC	0,087%	30/04/2011	30/04/2016	EUR	7.437.000	7.437.000	225,85	2,306%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo del Polesine-Rovigo SC	3,200%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	12.122.100	12.122.100	-	2,786%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo dell'Alta Brianza - Alzate Brianza SC	3,250%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	13.805.000	13.805.000	-	2,165%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo dell'Alta Brianza - Alzate Brianza SC	4,750%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	14.200.300	14.200.300	-	2,178%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Delle Prealpi SC	4,000%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	23.858.890	27.928.000	-	1,243%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	4,000%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	17.774.430	17.848.800	-	2,607%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,500%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	10.567.977	17.848.800	-	2,622%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,500%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	19.683.169	27.610.000	-	2,582%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	0,000%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	27.584.200	27.584.200	-	2,312%	-	Banks	86,052	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	4,000%	30/05/2011	30/05/2016	EUR	9.037.341	17.132.400	-	2,737%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Cambiano Castelfiorentino Firenze SCpA	4,000%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	13.649.200	13.649.200	-	1,290%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Caravaggio SC	4,000%	10/03/2011	10/03/2016	EUR	17.655.050	20.730.000	-	2,380%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carugate	3,700%	09/06/2011	09/06/2016	EUR	7.264.200	7.264.200	-	2,291%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Castel Goffredo SC	3,430%	03/01/2011	03/01/2016	EUR	7.796.462	20.062.950	-	2,645%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Cherasco SC	4,000%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	9.982.811	14.200.300	-	2,556%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Fano	3,750%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	17.969.900	17.969.900	-	2,216%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Fano	3,750%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	17.969.900	17.969.900	-	2,216%	-	Banks	100,000	IT

Banca di Credito Cooperativo di Ghisalba SC	4,000%	01/08/2011	01/08/2016	EUR	7.119.350	7.119.350	-	2,479%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Roma SC	0,950%	08/07/2011	08/07/2016	EUR	12.029.414	12.029.414	234,34	2,391%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Roma SC	3,500%	19/01/2011	19/01/2016	EUR	85.517.120	85.517.120	-	2,670%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sala di Cesenatico SC	3,450%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	9.663.500	9.663.500	221,41	2,262%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sassano SC	4,850%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	8.575.987	10.067.400	-	2,557%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Triuggio e della Valle del Lambro SC	4,000%	23/05/2011	23/05/2016	EUR	7.020.500	7.020.500	-	1,530%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Triuggio e della Valle del Lambro SC	3,500%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	6.911.500	6.911.500	-	1,485%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Vignole e della Montagna Pistoiese SC	3,750%	17/01/2011	17/01/2016	EUR	6.647.500	6.647.500	-	2,890%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo G Toniolo di San Cataldo	2,300%	10/03/2011	10/03/2016	EUR	6.910.000	6.910.000	-	1,228%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Picena SC/Castignano	3,500%	17/01/2011	17/01/2016	EUR	9.229.389	13.295.000	-	2,643%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Pordenonese SC	0,000%	01/12/2011	01/12/2016	EUR	9.281.392	13.443.500	271,44	2,692%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito di Verolavecchia SA	4,000%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	12.274.601	13.977.000	-	2,573%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Forli Credito Cooperativo SC	0,262%	12/05/2011	12/05/2016	EUR	28.464.000	28.464.000	116,57	1,214%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Imola SpA	3,000%	22/04/2011	22/04/2016	EUR	29.107.800	29.107.800	-	1,165%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Legnano SpA	3,250%	18/03/2011	18/03/2016	EUR	70.825.500	70.825.500	-	0,839%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Legnano SpA	4,500%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	9.637.142	9.637.142	-	1,016%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Piacenza	3,500%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	6.911.500	6.911.500	-	1,322%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Piacenza	0,200%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	31.429.997	42.642.000	113,21	1,215%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Sassari SpA	3,000%	26/01/2011	26/01/2016	EUR	34.208.000	34.208.000	-	1,259%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Valle Camonica SpA	3,400%	28/02/2011	29/02/2016	EUR	13.792.100	13.792.100	-	0,571%	-	Banks	100,000	IT
Banca Finnat Euramerica SpA	0,378%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	7.220.500	36.102.500	131,04	1,358%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	0,000%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	38.417.735	38.417.735	129,57	1,274%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	3,150%	16/06/2011	16/06/2016	EUR	105.191.434	105.191.434	121,94	1,267%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	2,600%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	10.147.123	10.147.123	97,65	1,123%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	2,750%	11/03/2011	11/03/2016	EUR	96.394.506	96.394.506	111,91	1,167%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	3,200%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	39.989.461	39.989.461	98,95	1,114%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	0,710%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	2.612.301	2.612.301	103,66	1,104%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca Intermobiliare SpA	5,000%	17/03/2011	15/03/2016	EUR	14.010.400	14.010.400	-	2,284%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	2,000%	06/06/2011	06/06/2016	EUR	14.191.195	29.206.000	219,25	2,241%	-	Banks	100,000	IT

Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	4,600%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	55.087.980	55.087.980	-	1,532%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	4,000%	18/03/2011	18/03/2016	EUR	385.276.555	385.276.555	-	1,183%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	0,000%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	134.585.788	134.585.788	-	2,085%	-	Banks	82,132	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	0,698%	31/01/2011	31/01/2016	EUR	42.597.670	42.597.670	203,10	2,080%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	0,814%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	68.257.103	68.257.103	149,81	1,546%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	0,899%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	4.400.892	4.400.892	272,53	2,773%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	1,049%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	5.703.699	5.703.699	255,62	2,604%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	4,000%	06/06/2011	06/06/2016	EUR	213.233.006	213.233.006	-	2,050%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	5,000%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	7.095.000	7.095.000	-	2,315%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	3,800%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	235.738.026	235.738.026	-	1,944%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	0,000%	02/09/2011	02/09/2016	EUR	55.881.704	55.881.704	-	2,610%	-	Banks	84,590	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	0,698%	01/08/2011	01/08/2016	EUR	7.119.350	7.119.350	263,59	2,684%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	4,900%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	5.131.530	5.131.530	-	2,480%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	2,300%	31/01/2011	31/01/2016	EUR	117.514.781	117.514.781	95,82	0,936%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	2,000%	30/11/2011	30/11/2016	EUR	69.911.598	69.911.598	109,25	1,071%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,000%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	158.609.150	158.609.150	-	0,970%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,000%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	95.070.242	95.070.242	-	1,025%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,000%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	87.010.242	87.010.242	-	1,019%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,400%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	111.742.216	111.742.216	-	1,037%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,982%	13/07/2011	13/07/2016	EUR	54.297.411	54.297.411	23,27	0,211%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,680%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	33.339.226	33.339.226	27,37	0,252%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,300%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	51.677.339	51.677.339	-	1,078%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	2,100%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	24.576.143	24.576.143	102,83	1,006%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,685%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	11.371.130	11.371.130	34,66	0,325%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,500%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	4.314.600	4.314.600	-	1,200%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,685%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	25.106.367	25.106.367	10,99	0,088%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,687%	31/08/2011	31/08/2016	EUR	13.590.071	13.590.071	108,47	1,063%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	3,550%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	34.824.960	34.824.960	-	1,075%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	3,500%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	215.730.000	215.730.000	-	0,665%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,587%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	36.622.920	36.622.920	30,41	0,282%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,400%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	10.592.592	10.592.592	-	1,150%	-	Banks	100,000	IT

Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,585%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	22.051.455	22.051.455	30,38	0,282%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nuova SpA	3,750%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	1.764.294	14.826.000	-	1,503%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nuova SpA	4,000%	05/08/2011	05/08/2016	EUR	35.613.250	35.613.250	-	2,877%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nuova SpA	4,000%	11/10/2011	11/10/2016	EUR	5.122.158	27.281.800	-	1,955%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nuova SpA	4,500%	15/12/2011	15/12/2016	EUR	6.503.750	6.503.750	-	3,346%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	5,000%	29/03/2011	29/03/2016	EUR	21.121.500	21.121.500	-	2,687%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	5,000%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	9.471.020	21.856.200	-	2,705%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	3,500%	17/01/2011	17/01/2016	EUR	19.788.278	19.788.278	-	2,919%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	4,000%	21/02/2011	21/02/2016	EUR	13.676.700	13.676.700	-	2,619%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	5,000%	23/05/2011	23/05/2016	EUR	12.405.224	12.405.224	-	2,720%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	4,500%	26/05/2011	26/05/2016	EUR	7.771.280	7.771.280	-	2,713%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	4,500%	07/07/2011	07/07/2016	EUR	7.173.050	7.173.050	-	2,729%	-	Banks	100,000	IT
Banca Picena Truentina Credito Cooperativo Societa Cooperativa	2,750%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	11.483.134	21.590.250	240,96	2,458%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Commercio e Industria SpA	2,000%	31/10/2011	31/10/2016	EUR	8.608.928	8.608.928	-	1,588%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Commercio e Industria SpA	2,700%	28/02/2011	29/02/2016	EUR	6.896.050	6.896.050	-	1,538%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Frusinate Societa Cooperativaper Azioni	4,000%	01/10/2011	01/10/2016	EUR	8.402.054	13.267.100	-	1,382%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Lazio Societa' Cooperativa per Azioni	4,000%	14/06/2011	14/06/2016	EUR	7.235.850	7.235.850	-	2,246%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Alto Adige SCpA Suedtiroler Volksbank Genossenschaft auf Akt	0,290%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	388.735	388.735	178,86	1,767%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Alto Adige SCpA Suedtiroler Volksbank Genossenschaft auf Akt	3,000%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	1.223.796	1.223.796	173,43	1,782%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	2,800%	24/01/2011	24/01/2016	EUR	68.210.000	68.210.000	128,68	1,336%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	3,900%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	60.967.987	60.967.987	-	1,149%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	5,000%	10/10/2011	10/10/2016	EUR	121.431.263	121.431.263	-	1,066%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	3,700%	04/01/2011	04/01/2016	EUR	99.855.000	99.855.000	-	1,001%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	4,100%	05/08/2011	05/08/2016	EUR	35.613.250	35.613.250	-	1,218%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	4,750%	08/04/2011	08/04/2016	EUR	7.210.750	7.210.750	-	1,212%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	3,750%	30/03/2011	30/03/2016	EUR	70.630.000	70.630.000	-	0,885%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ancona SpA	4,000%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	30.384.778	43.531.200	-	1,591%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ancona SpA	3,200%	20/05/2011	20/05/2016	EUR	20.978.199	20.978.199	-	1,560%	-	Banks	100,000	IT

Banca Popolare di Ancona SpA	2,000%	24/01/2011	24/01/2016	EUR	20.461.636	20.461.636	-	1,508%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bari SCpA	3,000%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	21.544.211	21.544.211	-	2,294%	-	Banks	95,000	IT
Banca Popolare di Bari SCpA	3,875%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	13.078.476	13.078.476	-	2,269%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,000%	16/12/2011	16/12/2016	EUR	16.899.986	16.899.986	-	1,374%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,250%	25/11/2011	25/11/2016	EUR	11.361.673	11.361.673	-	1,375%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,250%	10/10/2011	10/10/2016	EUR	40.983.000	40.983.000	-	1,358%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Cremona Scrl	1,850%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	349.425.000	349.425.000	104,18	1,090%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Lanciano e Sulmona SpA	0,000%	14/04/2011	14/04/2016	EUR	7.242.300	7.242.300	-	1,176%	-	Banks	84,020	IT
Banca Popolare di Lanciano e Sulmona SpA	4,750%	15/11/2011	15/11/2016	EUR	6.771.450	6.771.450	-	1,480%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Lodi SpA	1,799%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	353.700.000	353.700.000	135,14	1,399%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Lodi SpA	1,864%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	344.802.500	344.802.500	131,08	1,359%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Mantova SpA	3,250%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	6.988.500	6.988.500	-	0,685%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	3,250%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	419.310.000	419.310.000	-	0,580%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Novara Scrl	4,750%	14/03/2011	31/03/2016	EUR	276.539.996	276.539.996	-	1,472%	-	Banks	99,526	IT
Banca Popolare di Puglia e Basilicata SCPA	4,800%	08/08/2011	08/08/2016	EUR	7.250.466	7.250.466	-	2,948%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	5,000%	06/06/2011	06/06/2016	EUR	14.603.000	14.603.000	-	1,405%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	4,000%	04/04/2011	04/04/2016	EUR	14.215.500	14.215.500	-	1,359%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	5,000%	13/04/2011	13/04/2016	EUR	7.224.950	7.224.950	-	1,418%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	5,000%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	6.982.000	6.982.000	-	1,408%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	5,000%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	7.191.000	7.191.000	-	1,457%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,500%	14/01/2011	14/01/2016	EUR	6.674.000	6.674.000	-	1,206%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Verona - S.Geminiano e S.Prospiero SpA	4,750%	14/03/2011	31/03/2016	EUR	517.614.703	517.614.703	-	1,429%	-	Banks	99,526	IT
Banca Popolare di Verona - S.Geminiano e S.Prospiero SpA	1,799%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	1.077.525.000	1.077.525.000	139,46	1,443%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	7,000%	29/12/2011	29/12/2016	EUR	129.416.000	129.416.000	-	3,238%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	3,000%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	12.703.489	12.703.489	309,00	3,138%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	0,000%	28/09/2011	28/09/2016	EUR	849.389	849.389	334,75	3,396%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	4,000%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	104.806.535	104.806.535	-	2,315%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	5,000%	05/08/2011	05/08/2016	EUR	66.925.844	66.925.844	-	3,115%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	3,750%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	20.949.138	20.949.138	-	2,857%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	4,000%	15/06/2011	15/06/2016	EUR	7.763.033	42.615.000	-	3,094%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	4,000%	18/04/2011	18/04/2016	EUR	21.357.000	21.357.000	-	2,708%	-	Banks	100,000	IT

Banca Popolare di Vicenza	4,000%	25/03/2011	25/03/2016	EUR	102.839.790	102.839.790	-	2,345%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	4,250%	16/09/2011	16/09/2016	EUR	41.392.200	41.392.200	-	3,242%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	4,000%	30/03/2011	30/03/2016	EUR	49.441.000	49.441.000	-	2,607%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Etica Scpa	3,000%	11/01/2011	11/01/2016	EUR	7.208.393	7.781.640	-	1,137%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Etica Scpa	3,000%	08/04/2011	08/04/2016	EUR	7.210.750	7.210.750	-	1,178%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Friuladria SpA	2,500%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	19.576.132	19.576.132	125,27	1,231%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	4,500%	07/09/2011	07/09/2016	EUR	7.704.296	7.704.296	-	2,534%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	4,000%	06/07/2011	06/07/2016	EUR	8.450.324	42.996.900	-	2,361%	-	Banks	100,000	IT
Banca San Biagio del Veneto Orientale Banca di Credito Cooperativo SC	0,800%	21/07/2011	21/07/2016	EUR	7.193.750	7.193.750	135,92	1,407%	-	Banks	100,000	IT
Banca San Giorgio Quinto Valle Agno Credito Cooperativo	4,000%	31/01/2011	31/01/2016	EUR	17.806.100	17.806.100	-	2,062%	-	Banks	100,000	IT
Banca Sella SpA	3,800%	10/05/2011	10/05/2016	EUR	28.712.000	28.712.000	-	1,274%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	0,550%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	43.532.400	43.532.400	118,41	1,232%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	0,396%	21/03/2011	21/03/2016	EUR	42.671.700	42.671.700	114,63	1,194%	-	Banks	100,000	IT
BancaSai SpA	3,000%	22/04/2011	22/04/2016	EUR	5.297.620	5.297.620	147,18	1,520%	-	Banks	100,000	IT
BancaSai SpA	3,000%	11/03/2011	11/03/2016	EUR	8.326.740	8.326.740	143,88	1,487%	-	Banks	100,000	IT
Bance di Credito Cooperativo di Busto Garolfo e Buguggiate	4,250%	23/05/2011	23/05/2016	EUR	13.159.225	14.041.000	-	2,682%	-	Banks	100,000	IT
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4,750%	10/02/2011	10/02/2016	EUR	2.725.200.000	2.725.200.000	-	0,078%	A	Banks	99,344	ES
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4,000%	16/09/2011	16/09/2016	EUR	74.505.960	74.505.960	-	0,347%	-	Banks	100,000	ES
Banco BPI SA	6,150%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	37.921.943	37.921.943	-	2,200%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	6,000%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	33.430.221	33.430.221	-	2,150%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	5,400%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	3.193.520	3.193.520	-	2,306%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	4,550%	15/11/2011	15/11/2016	EUR	277.629	277.629	-	2,642%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	3,950%	31/08/2011	31/08/2016	EUR	1.625.448	1.625.448	-	2,399%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	3,800%	15/11/2011	15/11/2016	EUR	530.882	530.882	-	2,591%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	3,650%	17/10/2011	17/10/2016	EUR	621.059	621.059	-	2,578%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	3,600%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	672.450	672.450	-	2,487%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	4,550%	28/10/2011	28/10/2016	EUR	419.195	419.195	-	2,572%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	3,800%	28/10/2011	28/10/2016	EUR	484.340	484.340	-	2,547%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	4,400%	17/10/2011	17/10/2016	EUR	90.887	90.887	-	2,585%	-	Banks	100,000	PT

Banco BPI SA	4,650%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	2.208.933	2.208.933	-	2,469%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	3,900%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	1.364.464	1.364.464	-	2,518%	-	Banks	100,000	PT
Banco BPI SA	6,100%	13/05/2011	13/05/2016	EUR	9.830.940	9.830.940	-	2,342%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	5,000%	11/07/2011	11/07/2016	EUR	4.787.218	4.787.218	-	2,154%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	4,500%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	90.772.807	116.543.054	-	1,547%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	5,000%	07/06/2011	07/06/2016	EUR	230.462	230.462	-	1,992%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	4,125%	11/07/2011	11/07/2016	EUR	747.300	747.300	-	2,091%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	4,625%	07/06/2011	07/06/2016	EUR	4.924.838	4.924.838	-	1,992%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	4,500%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	215.334	246.519.960	-	1,877%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	3,750%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	21.279.425	21.279.425	-	1,721%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	4,125%	07/06/2011	07/06/2016	EUR	998.179	1.237.448	-	2,017%	-	Banks	100,000	PT
Banco Comercial Portugues SA	4,875%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	1.375.166	1.375.166	-	1,830%	-	Banks	100,000	PT
Banco di Brescia SpA	4,000%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	14.382.000	14.382.000	-	1,825%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Brescia SpA	5,000%	13/05/2011	13/05/2016	EUR	7.058.400	7.058.400	-	1,432%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,500%	04/07/2011	04/07/2016	EUR	4.903.673	29.058.800	-	0,872%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	1,986%	29/12/2011	29/12/2016	EUR	16.824.080	16.824.080	337,35	3,351%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,000%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	4.388.778	4.388.778	-	0,794%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,500%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	35.850.077	35.850.077	-	2,705%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,000%	07/02/2011	07/02/2016	EUR	14.194.112	27.088.000	-	2,631%	-	Banks	100,000	IT
Banco di San Giorgio SpA	3,500%	18/03/2011	18/03/2016	EUR	12.748.590	12.748.590	-	1,305%	-	Banks	100,000	IT
Banco di San Giorgio SpA	2,031%	09/05/2011	09/05/2016	EUR	210.371.700	210.371.700	111,35	1,162%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	3,600%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	62.896.500	62.896.500	-	1,139%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	3,900%	15/11/2011	15/11/2016	EUR	11.347.596	27.085.800	-	1,323%	-	Banks	100,000	IT
Banco Espanol de Credito SA	4,080%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	689.957.400	689.957.400	-	0,344%	BBB+	Banks	100,000	ES
Banco Pastor SA	5,800%	16/12/2011	16/12/2016	EUR	0	650.600.000	-	0,687%	-	Banks	100,000	ES
Banco Popolare SC	4,750%	14/03/2011	31/03/2016	EUR	2.168.403.500	2.168.403.500	-	0,244%	-	Banks	99,526	IT
Banco Popolare SC	4,800%	31/08/2011	30/08/2016	EUR	449.159.700	449.159.700	-	1,491%	NR	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,260%	31/10/2011	31/10/2016	EUR	148.198.232	148.198.232	160,07	1,649%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,800%	31/01/2011	31/01/2016	EUR	66.781.093	66.781.093	150,42	1,553%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	31/10/2011	31/10/2016	EUR	901.697.647	901.697.647	-	1,549%	-	Banks	83,500	IT
Banco Popolare SC	4,100%	31/05/2011	30/05/2016	EUR	526.837.890	526.837.890	-	1,436%	NR	Banks	100,000	IT

Banco Popolare SC	0,090%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	232.558.491	232.558.491	141,03	1,458%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,500%	10/01/2011	10/01/2016	EUR	307.731.804	307.731.804	-	1,382%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,960%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	35.583.618	35.583.618	152,55	1,573%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,050%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	48.781.063	48.781.063	155,57	1,604%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	28/07/2011	28/07/2016	EUR	11.008.729	11.008.729	-	1,695%	-	Banks	84,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	29/03/2011	29/03/2016	EUR	490.539.797	490.539.797	-	1,423%	-	Banks	81,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	71.447.759	71.447.759	-	1,596%	-	Banks	83,000	IT
Banco Santander SA	4,625%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	1.439.760.000	1.439.760.000	-	0,150%	-	Diversified Banks	99,485	ES
Banco Santander SA	4,625%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	1.346.900.000	1.346.900.000	-	0,079%	-	Diversified Banks	99,481	ES
Banco Santander Totta SA	5,850%	29/04/2011	04/04/2016	EUR	16.605.120	16.605.120	-	1,484%	-	Banks	100,000	PT
Banco Santander Totta SA	4,019%	26/01/2011	26/01/2016	EUR	6.773.184	6.773.184	-	1,399%	-	Banks	100,000	PT
Banco Santander Totta SA	5,760%	27/05/2011	29/05/2016	EUR	15.392.603	15.392.603	-	1,586%	-	Banks	100,000	PT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	2,375%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	13.449.000	13.449.000	-	0,993%	-	Banks	98,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	2,000%	30/08/2011	30/08/2016	EUR	14.421.000	14.421.000	-	0,972%	-	Banks	98,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	0,287%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	14.393.500	14.393.500	109,30	1,071%	-	Banks	100,000	AT
Bank Ochrony Srodowiska Finance AB	6,000%	11/05/2011	11/05/2016	EUR	355.480.000	355.480.000	-	0,958%	-	Banks	100,000	SE
Bankhaus Carl Spaengler & Co AG	3,250%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	7.220.500	7.220.500	-	0,544%	-	Financial Services	100,500	AT
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4,100%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	353.100.000	353.100.000	-	0,459%	-	Banks	100,000	FR
Banque PSA Finance SA	4,250%	25/02/2011	25/02/2016	EUR	1.376.020.000	1.376.020.000	-	0,360%	BB+	Automobiles Manufacturing	99,978	FR
Barclays Bank PLC	4,125%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	1.747.125.000	1.747.125.000	-	0,111%	A-	Banks	99,500	GB
Barclays Bank PLC	1,821%	09/11/2011	09/11/2016	EUR	1.530.619	1.530.619	73,06	0,657%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,150%	28/04/2011	28/04/2016	EUR	31.016.855	46.848.575	54,66	0,525%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,100%	20/09/2011	20/09/2016	EUR	1.367.600	1.367.600	65,22	0,630%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,582%	12/10/2011	12/10/2016	EUR	897.709	13.741.846	63,39	0,612%	A-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,000%	19/10/2011	19/10/2016	EUR	474.245	20.679.300	137,94	1,357%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,482%	14/10/2011	14/10/2016	EUR	7.200.700	7.200.700	60,00	0,578%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,235%	29/09/2011	29/09/2016	EUR	203.796	6.317.676	62,25	0,600%	NR	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,180%	14/09/2011	14/09/2016	EUR	5.142.863	5.142.863	65,70	0,635%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,700%	28/07/2011	28/07/2016	EUR	30.366.293	33.764.490	54,76	0,526%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,137%	08/08/2011	08/08/2016	EUR	23.542.690	23.542.690	51,63	0,494%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,400%	04/05/2011	04/05/2016	EUR	4.435.546	4.435.546	408,42	4,229%	-	Banks	100,000	GB

Barclays Bank PLC	1,741%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	17.656.580	23.816.643	56,57	0,544%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,000%	19/10/2011	19/10/2016	EUR	323.976	323.976	69,97	0,678%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,800%	17/02/2011	17/02/2016	EUR	6.122.828	6.797.100	60,13	0,579%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,500%	11/11/2011	11/11/2016	EUR	1.550.741	2.025.036	72,15	0,700%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,250%	07/04/2011	07/04/2016	EUR	3.753.488	4.309.719	64,26	0,621%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,150%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	1.330.384	1.330.384	374,87	3,893%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,737%	09/12/2011	09/12/2016	EUR	1.845.005	5.227.514	65,79	0,636%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,000%	07/12/2011	07/12/2016	EUR	20.136.000	20.136.000	63,03	0,608%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,300%	21/01/2011	21/01/2016	EUR	2.616.086	20.374.500	61,08	0,589%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,100%	20/07/2011	20/07/2016	EUR	262.737	1.611.927	66,82	0,646%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,200%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	11.783.040	11.783.040	297,98	3,124%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,500%	28/12/2011	28/12/2016	EUR	733.579	1.097.134	73,84	0,716%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,000%	12/09/2011	12/09/2016	EUR	20.410.500	20.410.500	59,18	0,570%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,800%	20/07/2011	20/07/2016	EUR	3.871.465	3.871.465	64,52	0,623%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,250%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	1.487.048	1.909.589	65,52	0,633%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,250%	21/01/2011	21/01/2016	EUR	3.838.556	4.895.313	59,38	0,572%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,000%	14/03/2011	14/03/2016	EUR	4.583.026	6.545.781	62,55	0,604%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,300%	25/02/2011	25/02/2016	EUR	9.866.063	9.866.063	55,85	0,536%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,250%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	8.891.736	10.565.492	61,68	0,595%	-	Banks	101,000	GB
Barclays Bank PLC	3,000%	21/02/2011	22/02/2016	EUR	2.878.945	2.878.945	63,07	0,609%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,200%	28/02/2011	29/02/2016	EUR	8.177.336	12.692.870	59,17	0,570%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,000%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	409.571	409.571	66,36	0,642%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,750%	25/02/2011	25/02/2016	EUR	4.147.324	5.399.502	61,97	0,598%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,500%	07/02/2011	08/02/2016	EUR	1.229.795	1.229.795	61,38	0,592%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,500%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	12.085.053	15.323.180	55,34	0,531%	-	Banks	100,000	GB
Bastei Lubbe AG	6,750%	26/10/2011	26/10/2016	EUR	41.491.200	41.491.200	-	1,475%	-	Publishing & Broadcasting	100,000	DE
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	0,000%	28/10/2011	28/10/2016	EUR	28.324.000	28.324.000	124,39	1,222%	-	Banks	100,500	AT
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	3,375%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	71.001.500	71.001.500	-	1,006%	-	Banks	100,000	AT
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	0,102%	12/09/2011	12/09/2016	EUR	136.070.000	136.070.000	107,19	1,120%	-	Banks	100,000	AT

BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	0,000%	24/11/2011	24/11/2016	EUR	133.402.000	133.402.000	118,23	1,160%	-	Banks	100,000	AT
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	3,375%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	69.332.500	69.332.500	-	1,040%	-	Banks	100,287	AT
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	4,000%	17/05/2011	17/05/2016	EUR	7.084.800	7.084.800	-	1,124%	-	Banks	100,000	AT
Bayerische Landesbank	0,481%	25/10/2011	25/10/2016	EUR	13.917.600	13.917.600	24,32	0,221%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	0,487%	01/12/2011	01/12/2016	EUR	13.443.500	13.443.500	24,79	0,226%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	2,500%	04/11/2011	04/11/2016	EUR	275.884.000	275.884.000	-	0,139%	-	Banks	100,750	DE
Bayerische Landesbank	3,375%	10/03/2011	10/03/2016	EUR	276.400.000	276.400.000	-	0,435%	-	Banks	99,960	DE
Bayerische Landesbank	1,750%	21/09/2011	21/09/2016	EUR	137.408.000	137.408.000	19,18	0,170%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	2,000%	12/12/2011	11/12/2016	EUR	132.032.000	132.032.000	-	0,557%	-	Banks	99,830	DE
Bayerische Landesbank	2,750%	03/03/2011	03/03/2016	EUR	69.677.500	69.677.500	59,25	0,571%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbodenkreditanstalt	0,184%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	57.173.200	57.173.200	3,92	0,087%	AAA	Government Development Banks	100,000	DE
BBBank eG	3,000%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	7.317.000	7.317.000	-	0,628%	-	Banks	100,200	DE
BBBank eG	2,400%	12/01/2011	12/01/2016	EUR	6.541.500	6.541.500	-	0,589%	-	Banks	100,210	DE
BBVA Senior Finance SAU	4,875%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	873.680.500	873.680.500	-	0,259%	BBB	Banks	99,831	ES
BCC di Recanati e Colmurano Societa Cooperativa	3,750%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	56.856.000	56.856.000	-	2,036%	-	Banks	100,000	IT
Bekaert SA	4,125%	06/12/2011	06/12/2016	EUR	274.632.350	274.632.350	-	1,279%	-	Manufactured Goods	101,900	BE
Belfius Financing Co	4,750%	07/04/2011	07/04/2016	EUR	95.231.340	95.231.340	-	1,488%	-	Banks	100,500	LU
Belfius Financing Co	5,000%	08/06/2011	08/06/2016	EUR	365.127.500	365.127.500	-	1,304%	-	Banks	100,500	LU
Belfius Financing Co	4,720%	06/07/2011	06/07/2016	EUR	186.319.900	186.319.900	-	1,442%	-	Banks	100,500	LU
Belfius Financing Co	3,500%	07/10/2011	07/10/2016	EUR	22.172.292	22.172.292	-	1,503%	-	Banks	100,500	LU
Belfius Financing Co	5,250%	06/05/2011	06/05/2016	EUR	49.037.108	49.037.108	-	1,537%	-	Banks	100,500	LU
Belfius Financing Co	2,600%	07/09/2011	07/09/2016	EUR	29.782.257	29.782.257	151,26	1,491%	-	Banks	100,000	LU
Belfius Financing Co	2,200%	07/02/2011	07/02/2016	EUR	95.715.448	95.715.448	141,50	1,393%	-	Banks	100,000	LU
Berlin Hyp AG	2,900%	08/02/2011	08/02/2016	EUR	13.665.000	13.665.000	-	0,319%	-	Consumer Finance	99,860	DE
Berlin Hyp AG	3,000%	09/03/2011	09/03/2016	EUR	50.040.000	50.040.000	-	0,263%	-	Consumer Finance	100,330	DE
Berlin Hyp AG	2,125%	25/11/2011	25/11/2016	EUR	13.240.500	13.240.500	-	0,271%	-	Consumer Finance	99,460	DE
Berlin Hyp AG	0,668%	22/08/2011	22/08/2016	EUR	8.632.440	8.632.440	41,73	0,395%	-	Consumer Finance	99,905	DE
Berlin Hyp AG	3,000%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	13.805.000	13.805.000	-	0,319%	-	Consumer Finance	100,250	DE

Berliner Volksbank eG	2,500%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	6.911.500	6.911.500	-	0,520%	-	Banks	100,000	DE
Berliner Volksbank eG	1,500%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	13.823.000	13.823.000	46,93	0,447%	-	Banks	100,500	DE
BFA Sociedad Tenedora de Acciones SAU	5,250%	07/04/2011	07/04/2016	EUR	2.416.531.000	2.416.531.000	-	0,260%	BBB	Banks	99,777	ES
BMW Finance NV	3,250%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	1.701.625.000	1.701.625.000	-	0,091%	A+	Automobiles Manufacturing	99,886	NL
BNP Paribas Fortis Funding SA	4,000%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	107.951.250	107.951.250	-	0,466%	-	Banks	102,000	LU
BNP Paribas Fortis Funding SA	3,250%	06/05/2011	06/05/2016	EUR	190.514.563	190.514.563	40,81	0,386%	-	Banks	100,000	LU
BNP Paribas Fortis Funding SA	3,000%	19/08/2011	19/08/2016	EUR	95.541.897	95.541.897	48,14	0,459%	-	Banks	100,500	LU
BNP Paribas Fortis Funding SA	2,500%	21/12/2011	21/12/2016	EUR	13.070.500	13.070.500	59,06	0,569%	-	Banks	101,250	LU
BNP Paribas SA	3,000%	20/07/2011	20/07/2016	EUR	213.030.000	213.030.000	35,34	0,331%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	3,500%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	2.094.600.000	2.094.600.000	-	0,115%	A+	Diversified Banks	99,748	FR
BNP Paribas SA	2,400%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	56.460.591	56.460.591	56,05	0,538%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	3,000%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	33.414.271	33.414.271	41,45	0,392%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	4,000%	08/04/2011	08/04/2016	EUR	46.869.875	46.869.875	-	0,398%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	2,750%	11/05/2011	11/05/2016	EUR	44.857.310	44.857.310	40,32	0,381%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,782%	12/10/2011	12/10/2016	EUR	10.098.530	10.098.530	31,16	0,290%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	2,000%	05/08/2011	05/08/2016	EUR	17.112.879	17.112.879	44,37	0,422%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	2,750%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	2.902.080	2.902.080	53,80	0,516%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Bollore SA	5,375%	26/05/2011	26/05/2016	EUR	494.536.000	494.536.000	-	0,547%	-	Transportation & Logistics	99,914	FR
BP Capital Markets PLC	3,472%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	1.223.447.500	1.223.447.500	-	0,186%	A	Integrated Oils	100,000	GB
BPCE SA	3,350%	07/10/2011	07/10/2016	EUR	686.400.909	686.400.909	-	0,636%	-	Banks	100,190	FR
BPCE SA	0,991%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	2.068.650	2.068.650	45,99	0,438%	-	Banks	100,000	FR
BPCE SFH SA	3,625%	12/05/2011	12/05/2016	EUR	3.984.960.000	3.984.960.000	-	0,007%	AAA	Banks	99,677	FR
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,719%	18/01/2011	18/01/2016	EUR	133.601.000	133.601.000	22,86	0,267%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	2,750%	06/01/2011	06/01/2016	EUR	65.141.500	65.141.500	-	0,359%	-	Banks	99,310	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	2,850%	15/06/2011	15/06/2016	EUR	71.025.000	71.025.000	-	0,193%	-	Banks	99,960	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	3,500%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	69.025.000	69.025.000	-	0,397%	-	Banks	99,020	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	3,000%	26/10/2011	26/10/2016	EUR	69.152.000	69.152.000	-	0,440%	-	Banks	99,790	DE
Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA	3,000%	21/01/2011	21/01/2016	EUR	4.074.900	4.074.900	112,76	1,106%	-	Banks	100,000	FR
Caixa Geral de Depositos SA	5,050%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	73.170.000	73.170.000	-	1,951%	BB-	Banks	100,000	PT
Caixa Geral de Depositos SA	4,500%	19/01/2011	19/01/2016	EUR	80.880.000	80.880.000	-	1,990%	-	Banks	100,000	PT
Caixa Geral de Depositos SA	4,750%	14/02/2011	14/02/2016	EUR	67.480.000	67.480.000	-	1,682%	BB-	Banks	100,000	PT

Caixa Geral de Depositos SA	4,850%	14/09/2011	14/09/2016	EUR	66.308.641	66.308.641	-	2,204%	-	Banks	100,000	PT
Caixa Geral de Depositos SA	5,090%	08/06/2011	08/06/2016	EUR	58.420.400	58.420.400	-	2,107%	-	Banks	100,000	PT
Caixa Geral de Depositos SA	4,750%	14/03/2011	14/03/2016	EUR	69.948.500	69.948.500	-	1,635%	BB-	Banks	100,000	PT
Caixa Geral de Depositos SA	5,165%	08/07/2011	08/07/2016	EUR	51.346.800	51.346.800	-	2,176%	-	Banks	100,000	PT
Caixa Geral de Depositos SA	4,570%	12/08/2011	12/08/2016	EUR	29.466.450	29.466.450	-	2,316%	-	Banks	100,000	PT
Caixa Geral de Depositos SA	5,120%	03/11/2011	03/11/2016	EUR	53.931.150	53.931.150	-	2,386%	-	Banks	100,000	PT
Caixa Geral de Depositos SA	4,900%	13/10/2011	13/10/2016	EUR	28.864.290	28.864.290	-	2,421%	-	Banks	100,000	PT
CaixaBank SA	5,000%	22/02/2011	22/02/2016	EUR	3.004.804.000	3.004.804.000	-	0,146%	A	Banks	99,508	ES
CaixaBank SA	5,125%	27/04/2011	27/04/2016	EUR	1.835.625.000	1.835.625.000	-	0,147%	A	Banks	99,927	ES
CaixaBank SA	5,362%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	14.190.000	14.190.000	-	0,590%	-	Banks	100,000	ES
Caja de Ahorros de Murcia	5,050%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	14.187.700	14.187.700	-	0,823%	-	Banks	100,000	ES
Cajas Rurales Unidas SCC	5,000%	20/12/2011	20/12/2016	EUR	654.355.000	654.355.000	-	0,361%	BBB+	Banks	100,000	ES
Cap Gemini SA	5,250%	29/11/2011	29/11/2016	EUR	666.495.000	666.495.000	-	0,386%	BBB	Software & Services	99,665	FR
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	1,595%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	7.437.000	7.437.000	236,49	2,343%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	0,114%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	8.283.000	8.283.000	213,37	2,199%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	3,700%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	8.283.000	8.283.000	-	2,345%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	1,736%	16/06/2011	16/06/2016	EUR	7.081.500	7.081.500	254,01	2,518%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	0,049%	20/06/2011	20/06/2016	EUR	10.012.800	10.012.800	223,05	2,370%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia dell'Aquila SpA	0,500%	12/01/2011	12/01/2016	EUR	10.479.483	13.083.000	132,02	1,354%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia dell'Aquila SpA	5,000%	17/10/2011	17/10/2016	EUR	13.770.700	13.770.700	-	1,611%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	3,500%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	7.107.000	7.107.000	-	2,793%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	4,750%	25/10/2011	25/10/2016	EUR	13.917.600	13.917.600	-	3,047%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	4,750%	31/10/2011	31/10/2016	EUR	27.892.200	27.892.200	-	2,966%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	4,000%	20/09/2011	20/09/2016	EUR	8.149.528	13.676.000	-	2,968%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	3,600%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	7.437.000	7.437.000	-	2,804%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	3,600%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	7.183.500	7.183.500	-	2,807%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Alessandria SpA	3,250%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	69.885.000	69.885.000	-	0,474%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	2,500%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	13.805.000	13.805.000	138,61	1,364%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	0,487%	01/12/2011	01/12/2016	EUR	33.608.750	33.608.750	141,81	1,396%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	2,520%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	12.846.613	12.846.613	139,72	1,375%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	0,984%	11/07/2011	01/07/2016	EUR	7.023.500	7.023.500	423,69	4,215%	-	Banks	100,000	IT

Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	0,000%	02/11/2011	02/11/2016	EUR	3.354.219	3.354.219	-	4,136%	-	Banks	85,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	2,500%	02/09/2011	02/09/2016	EUR	2.180.161	2.180.161	418,80	4,236%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	0,988%	02/09/2011	02/09/2016	EUR	2.627.555	35.507.500	420,94	4,187%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	2,500%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	3.344.739	3.344.739	554,46	5,593%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	0,678%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	26.657.148	26.657.148	398,64	3,964%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	3,000%	22/03/2011	22/03/2016	EUR	7.137.436	7.137.436	406,82	4,116%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bra SpA	4,250%	17/11/2011	17/11/2016	EUR	13.471.700	13.471.700	-	1,262%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Cesena SpA/Old	3,200%	08/09/2011	08/09/2016	EUR	275.852	275.852	-	1,454%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Fano SpA	4,250%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	20.799.750	20.799.750	-	2,951%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Fano SpA	4,000%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	14.421.500	14.421.500	-	2,890%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Parma e Piacenza SpA	2,500%	25/07/2011	25/07/2016	EUR	27.404.999	27.404.999	104,91	1,027%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Parma e Piacenza SpA	2,500%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	80.657.460	80.657.460	96,61	0,944%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Saluzzo SpA	3,150%	17/05/2011	17/05/2016	EUR	9.445.455	9.445.455	-	2,437%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di San Miniato SpA	4,000%	07/11/2011	07/11/2016	EUR	17.567.164	17.567.164	-	1,349%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di San Miniato SpA	3,500%	19/09/2011	19/09/2016	EUR	6.818.250	6.818.250	-	1,348%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di San Miniato SpA	3,600%	22/07/2011	22/07/2016	EUR	7.182.500	7.182.500	-	1,317%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di San Miniato SpA	3,250%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	28.380.000	28.380.000	-	1,212%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di San Miniato SpA	4,000%	23/12/2011	23/12/2016	EUR	8.156.271	8.156.271	-	1,404%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Savona SpA	0,530%	12/08/2011	12/08/2016	EUR	219.219.000	219.219.000	117,90	1,227%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio Fabriano e Cupramontana SpA	0,560%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	7.100.150	7.100.150	213,65	2,185%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Alta ValdiSole e Pejo BCC SC	1,150%	16/08/2011	16/08/2016	EUR	7.202.550	7.202.550	196,08	2,009%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Banca di Credito Cooperativo di Treviglio SC	3,100%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	12.190.442	12.190.442	-	1,216%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Banca di Credito Cooperativo di Treviglio SC	3,750%	10/01/2011	10/01/2016	EUR	9.831.278	9.831.278	-	1,707%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Bassa Vallagarina Banca di Credito Cooperativo SC	2,860%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	9.676.100	9.676.100	-	2,444%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Centrofiemme Cavalese BCC SC	4,500%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	13.392.271	13.392.271	-	1,719%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale della Valle dei Laghi Banca di Credito Cooperativo SC	4,000%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	7.935.114	7.935.114	-	2,261%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Trento - Banca di Credito Cooperativo SC	4,250%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	28.882.000	28.882.000	-	2,447%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Tuenno-Val di Non Banca di Credito Cooperativo SC	3,150%	06/10/2011	06/10/2016	EUR	9.377.060	9.377.060	-	1,476%	-	Banks	100,000	IT

Cassa Rurale di Tuenno-Val di Non Banca di Credito Cooperativo SC	2,200%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	6.902.500	6.902.500	134,68	1,395%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Tuenno-Val di Non Banca di Credito Cooperativo SC	2,500%	01/05/2011	01/05/2016	EUR	17.848.800	17.848.800	133,37	1,382%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Binasco Credito Cooperativo SC	3,400%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	6.758.950	6.758.950	-	1,409%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	4,200%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	14.441.000	14.441.000	-	2,216%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	3,300%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	6.911.500	6.911.500	-	2,150%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Giudicarie Valsabbia Paganella SC	3,500%	02/09/2011	02/09/2016	EUR	7.101.500	7.101.500	-	1,488%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Giudicarie Valsabbia Paganella SC	4,000%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	14.874.000	14.874.000	-	1,421%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Lavis-Valle di Cembra Banca Credito Cooperativo SC	0,990%	20/12/2011	20/12/2016	EUR	20.057.289	20.057.289	261,48	2,593%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Val di Fassa e Agordino Banca di Credito Cooperativo SC	3,100%	02/11/2011	02/11/2016	EUR	7.406.776	13.746.800	-	2,666%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Val di Fassa e Agordino Banca di Credito Cooperativo SC	3,500%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	8.339.852	14.874.000	-	2,407%	-	Banks	100,000	IT
Christian Dior SE	4,000%	12/05/2011	12/05/2016	EUR	426.960.000	426.960.000	-	0,421%	-	Apparel & Textile Products	99,481	FR
CIC	3,250%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	58.008.600	58.008.600	28,18	0,382%	-	Banks	100,000	FR
CIC	3,600%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	2.891.070	2.891.070	42,26	0,521%	-	Banks	100,000	FR
CIC	3,050%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	16.138.800	16.138.800	582,89	5,807%	-	Banks	100,000	FR
CIC	5,500%	30/11/2011	30/11/2016	EUR	8.741.135	8.741.135	62,95	0,607%	-	Banks	100,000	FR
CIC	3,200%	26/10/2011	26/10/2016	EUR	9.681.280	9.681.280	55,21	0,530%	-	Banks	100,000	FR
CIC	3,800%	21/03/2011	21/03/2016	EUR	8.107.623	8.107.623	49,47	0,473%	-	Banks	100,000	FR
CIC	3,700%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	8.812.680	8.812.680	38,15	0,464%	-	Banks	100,000	FR
Cie de Financement Foncier SA	0,577%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	260.295.000	260.295.000	12,62	0,104%	AAA	Consumer Finance	100,000	FR
Cie Immobiliere de Belgique SA	7,000%	21/12/2011	21/12/2016	EUR	52.282.000	52.282.000	-	3,206%	-	Real Estate	100,000	BE
CIF Euromortgage SA	3,250%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	1.364.920.000	1.364.920.000	-	0,010%	-	Consumer Finance	99,565	FR
Commerzbank AG	4,000%	18/03/2011	18/03/2016	EUR	11.332.080	11.332.080	-	0,537%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	1,011%	21/07/2011	21/07/2016	EUR	4.312.800	4.312.800	53,13	0,509%	BBB+	Banks	99,670	DE
Commerzbank AG	8,535%	23/09/2011	27/09/2016	EUR	6.734.750	6.734.750	428,80	4,266%	-	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	2,700%	09/02/2011	09/02/2016	EUR	37.013.760	37.013.760	46,38	0,442%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	3,250%	09/11/2011	09/11/2016	EUR	2.312.935	2.312.935	-	0,639%	BBB+	Banks	100,000	DE

Commerzbank AG	1,140%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	14.440.000	14.440.000	36,11	0,449%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	1,181%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	27.436.000	27.436.000	46,65	0,515%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	4,000%	27/05/2011	27/05/2016	EUR	4.362.908	4.362.908	-	0,590%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	4,000%	16/02/2011	16/02/2016	EUR	4.741.695	4.741.695	-	0,569%	BBB+	Banks	100,000	DE
Communaute Francaise de Belgique	3,625%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	20.965.500	20.965.500	-	0,188%	-	Government Regional	99,614	BE
Comunidad Autonoma de Canarias	2,000%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	272.268.000	272.268.000	-	0,536%	-	Government Local	100,000	ES
Comunidad Foral de Navarra	5,529%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	281.336.400	281.336.400	-	0,290%	-	Government Local	100,000	ES
Comunidad Foral de Navarra	5,250%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	48.919.500	48.919.500	-	0,335%	A-	Government Local	100,000	ES
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands	3,875%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	5.073.495.000	5.073.495.000	-	0,092%	A+	Banks	99,857	NL
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	3,000%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	1.765.500	1.765.500	46,41	0,442%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	3,000%	14/03/2011	14/03/2016	EUR	4.406.756	4.406.756	42,32	0,401%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	3,300%	13/04/2011	13/04/2016	EUR	6.635.394	6.635.394	173,36	1,878%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	3,200%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	11.119.570	11.119.570	39,43	0,372%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	3,210%	14/09/2011	14/09/2016	EUR	4.457.148	4.457.148	47,63	0,454%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	3,620%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	3.249.225	3.249.225	45,91	0,437%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	3,900%	20/04/2011	21/03/2016	EUR	1.449.570	1.449.570	-	0,557%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	1,188%	25/05/2011	25/05/2016	EUR	2.821.000	2.821.000	40,01	0,378%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	2,000%	06/01/2011	06/01/2016	EUR	1.302.830	1.302.830	41,95	0,397%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	3,200%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	2.985.463	2.985.463	46,63	0,444%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	2,500%	04/02/2011	04/02/2016	EUR	2.661.641	2.661.641	41,42	0,392%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,010%	21/12/2011	21/12/2016	EUR	3.006.215	3.006.215	-	0,878%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,306%	04/07/2011	30/06/2016	EUR	2.760.586	2.760.586	73,05	0,708%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,331%	15/07/2011	06/07/2016	EUR	4.244.400	4.244.400	71,10	0,689%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,300%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	1.704.036	1.704.036	79,04	0,768%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,700%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	2.130.045	2.130.045	79,20	0,770%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,750%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	5.776.400	5.776.400	-	0,705%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,000%	28/03/2011	28/03/2016	EUR	3.497.466	3.497.466	71,68	0,695%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	2,250%	13/01/2011	13/01/2016	EUR	1.097.781	1.097.781	68,72	0,665%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	0,887%	10/06/2011	10/06/2016	EUR	3.061.875	3.061.875	70,55	0,684%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	2,800%	15/12/2011	15/12/2016	EUR	1.430.825	1.430.825	92,10	0,899%	-	Financial Services	100,000	FR

Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,150%	06/05/2011	06/05/2016	EUR	1.440.150	1.440.150	78,51	0,763%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole SA/London	3,625%	08/03/2011	08/03/2016	EUR	1.390.800.000	1.390.800.000	-	0,111%	A	Diversified Banks	99,444	GB
Credit Agricole SA/London	0,971%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	21.951.000	21.951.000	33,69	0,315%	A	Diversified Banks	100,000	GB
Credit Lyonnais SA	1,000%	29/08/2011	29/08/2016	EUR	942.825	942.825	88,68	0,865%	-	Banks	100,000	FR
Credit Mutuel Arkea SA	1,361%	11/02/2011	11/02/2016	EUR	33.802.000	33.802.000	24,69	0,295%	-	Banks	100,000	FR
Credit Suisse AG	2,400%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	7.198.800	7.198.800	54,05	0,518%	-	Banks	100,290	CH
Credit Suisse AG/London	2,000%	29/09/2011	29/09/2016	EUR	11.881.307	11.881.307	52,88	0,507%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	3,800%	27/04/2011	27/04/2016	EUR	19.589.790	19.589.790	-	0,617%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	3,300%	23/02/2011	23/02/2016	EUR	22.815.345	22.815.345	-	0,585%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	3,800%	25/05/2011	25/05/2016	EUR	25.941.916	25.941.916	-	0,608%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,900%	12/04/2011	12/04/2016	EUR	144.845.000	144.845.000	311,68	3,261%	-	Banks	101,500	GB
Credit Suisse AG/London	2,750%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	27.295.716	27.295.716	49,17	0,470%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,850%	30/11/2011	30/11/2016	EUR	15.506.773	15.506.773	-	0,649%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,800%	28/09/2011	28/09/2016	EUR	14.999.063	14.999.063	-	0,630%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,600%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	3.034.020	3.034.020	47,92	0,527%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	3,400%	27/07/2011	27/07/2016	EUR	26.621.821	26.621.821	-	0,606%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	3,600%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	34.215.009	34.215.009	-	0,597%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	1,900%	27/10/2011	27/10/2016	EUR	8.168.450	8.168.450	55,07	0,529%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,100%	29/12/2011	29/12/2016	EUR	4.407.909	4.407.909	60,10	0,579%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,700%	28/12/2011	28/12/2016	EUR	5.674.563	5.674.563	-	0,695%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,550%	12/09/2011	12/09/2016	EUR	13.607.000	13.607.000	53,08	0,509%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,250%	18/11/2011	18/11/2016	EUR	135.140.000	135.140.000	37,74	0,425%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,600%	26/10/2011	26/10/2016	EUR	9.459.994	9.459.994	-	0,653%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	3,150%	26/01/2011	26/01/2016	EUR	14.468.616	14.468.616	-	0,597%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,550%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	2.935.170	2.935.170	56,03	0,538%	-	Banks	100,000	GB
Credito Artigiano SpA	4,250%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	76.265.750	76.265.750	-	2,608%	-	Banks	100,000	IT
Credito Artigiano SpA	3,350%	12/04/2011	12/04/2016	EUR	14.484.500	14.484.500	-	2,444%	-	Banks	100,000	IT
Credito Artigiano SpA	4,000%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	21.632.250	21.632.250	-	2,607%	-	Banks	100,000	IT
Credito Artigiano SpA	3,350%	21/02/2011	21/02/2016	EUR	9.625.661	13.676.700	-	2,314%	-	Banks	100,000	IT
Credito Bergamasco SpA	4,750%	14/03/2011	31/03/2016	EUR	219.997.825	219.997.825	-	1,777%	-	Banks	99,526	IT

Credito Cooperativo dell'Adda e del Cremasco - Cassa Rurale SC	3,250%	04/04/2011	04/04/2016	EUR	11.372.400	11.372.400	-	2,314%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo di Brescia SC	3,800%	10/01/2011	10/01/2016	EUR	25.856.118	25.856.118	-	1,195%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo di Brescia SC	3,800%	11/04/2011	10/04/2016	EUR	26.142.176	26.142.176	-	1,242%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo di Brescia SC	4,500%	12/09/2011	10/09/2016	EUR	11.998.653	11.998.653	-	1,349%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Ravennate e Imolese SC	2,750%	10/06/2011	10/06/2016	EUR	18.687.500	18.687.500	128,66	1,335%	-	Banks	100,000	IT
Credito Piemontese SpA	4,000%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	8.652.900	8.652.900	-	2,466%	-	Banks	100,000	IT
Credito Siciliano SpA	4,000%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	21.632.250	21.632.250	-	2,607%	-	Banks	100,000	IT
Credito Siciliano SpA	4,000%	06/07/2011	06/07/2016	EUR	13.860.767	42.996.900	-	2,361%	-	Banks	100,000	IT
Credito Siciliano SpA	4,250%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	41.599.500	41.599.500	-	2,665%	-	Banks	100,000	IT
Credito Siciliano SpA	4,000%	02/02/2011	02/02/2016	EUR	20.682.150	20.682.150	-	2,221%	-	Banks	100,000	IT
Credito Trevigiano Banca di Credito Cooperativo SC	4,100%	13/05/2011	13/05/2016	EUR	10.766.883	14.116.800	-	1,536%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	4,250%	02/11/2011	02/11/2016	EUR	60.485.920	60.485.920	-	2,624%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	4,000%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	14.421.500	14.421.500	-	2,607%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	0,410%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	1.420.030	1.420.030	241,83	2,396%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	5,250%	14/06/2011	14/06/2016	EUR	1.447.170	1.447.170	-	2,464%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	0,460%	15/06/2011	15/06/2016	EUR	355.125	355.125	232,41	2,372%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	3,250%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	5.609.929	5.609.929	-	2,313%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	3,850%	11/07/2011	11/07/2016	EUR	1.474.935	1.474.935	-	2,507%	-	Banks	100,000	IT
Danone SA	2,500%	29/09/2011	29/09/2016	EUR	679.320.000	679.320.000	-	0,146%	A-	Food & Beverage	99,606	FR
Danske Bank A/S	3,875%	18/05/2011	18/05/2016	EUR	1.425.950.000	1.425.950.000	-	0,136%	A	Banks	99,470	DK
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,538%	22/08/2011	22/08/2016	EUR	23.019.840	23.019.840	74,51	0,723%	-	Banks	99,955	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,538%	07/09/2011	07/09/2016	EUR	7.030.750	7.030.750	72,86	0,777%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,210%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	6.988.500	6.988.500	72,07	0,769%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	3,600%	14/12/2011	30/12/2016	EUR	3.898.050	3.898.050	-	0,491%	-	Banks	103,890	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,522%	04/04/2011	04/04/2016	EUR	7.107.750	7.107.750	72,10	0,769%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	3,200%	10/06/2011	10/06/2016	EUR	33.062.500	33.062.500	-	0,795%	-	Banks	99,960	DE
Deutsche Apotheker-und Aertztebank eG	0,000%	25/02/2011	25/02/2016	EUR	11.008.160	11.557.192	-	0,474%	-	Banks	86,500	DE
Deutsche Bahn Finance BV	2,875%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	725.520.000	725.520.000	-	0,051%	AA	Government Agencies	99,638	NL
Deutsche Bank AG	2,000%	26/10/2011	28/10/2016	EUR	153.102.528	153.102.528	31,38	0,483%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,478%	18/08/2011	18/08/2016	EUR	80.764.800	80.764.800	26,94	0,438%	-	Diversified Banks	100,000	DE

Deutsche Bank AG	0,164%	14/07/2011	14/07/2016	EUR	56.919.180	56.919.180	22,91	0,387%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,250%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	219.199.965	219.199.965	21,02	0,288%	-	Diversified Banks	101,000	DE
Deutsche Bank AG	0,485%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	72.107.500	72.107.500	42,22	0,400%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,000%	12/10/2011	13/10/2016	EUR	267.240.915	267.240.915	11,39	0,283%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,500%	10/02/2011	10/02/2016	EUR	429.627.780	429.627.780	31,68	0,371%	-	Diversified Banks	101,000	DE
Deutsche Bank AG	0,000%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	698.850.000	698.850.000	46,63	0,444%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	3,000%	17/02/2011	17/02/2016	EUR	27.188.400	27.188.400	-	0,433%	-	Diversified Banks	99,000	DE
Deutsche Bank AG	3,200%	10/02/2011	10/02/2016	EUR	429.219.000	429.219.000	-	0,049%	-	Diversified Banks	101,000	DE
Deutsche Bank AG	0,163%	07/07/2011	07/07/2016	EUR	110.464.970	110.464.970	23,28	0,385%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,811%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	13.613.000	13.613.000	37,73	0,355%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,950%	14/07/2011	14/07/2016	EUR	24.495.070	24.495.070	-	0,467%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,800%	07/07/2011	07/07/2016	EUR	36.582.555	36.582.555	-	0,461%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	3,750%	08/02/2011	08/02/2016	EUR	10.043.775	10.043.775	-	0,778%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,000%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	88.487.100	88.487.100	34,49	0,514%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,750%	18/08/2011	18/08/2016	EUR	33.222.400	33.222.400	-	0,474%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,850%	04/08/2011	04/08/2016	EUR	62.603.996	62.603.996	-	0,469%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,600%	24/11/2011	24/11/2016	EUR	17.742.466	17.742.466	-	0,522%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,591%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	26.546.130	26.546.130	47,01	0,448%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,700%	13/10/2011	13/10/2016	EUR	24.878.269	24.878.269	-	0,503%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,550%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	20.276.850	20.276.850	43,37	0,412%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,955%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	10.759.200	10.759.200	54,78	0,526%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	3,300%	14/04/2011	14/04/2016	EUR	56.489.940	56.489.940	-	0,454%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,700%	22/12/2011	22/12/2016	EUR	12.396.740	12.396.740	-	0,540%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,985%	04/10/2011	04/10/2016	EUR	93.979.920	93.979.920	42,48	0,403%	BBB+	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	3,210%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	6.806.500	6.806.500	-	0,436%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,526%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	14.124.000	14.124.000	38,60	0,364%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,906%	14/02/2011	20/03/2016	EUR	67.480.000	67.480.000	39,89	0,377%	-	Diversified Banks	100,010	DE
Deutsche Bank AG	0,000%	15/12/2011	15/12/2016	EUR	13.007.500	13.007.500	101,32	0,991%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,809%	05/09/2011	05/09/2016	EUR	70.576.000	70.576.000	37,66	0,425%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	3,625%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	27.646.000	27.646.000	-	0,447%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG/London	3,100%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	200.046.570	200.046.570	-	0,647%	-	Banks	100,000	GB

Deutsche Bank AG/London	2,500%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	282.025.950	282.025.950	41,00	0,472%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	3,300%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	235.136.550	235.136.550	-	0,566%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,000%	08/12/2011	08/12/2016	EUR	35.998.020	35.998.020	65,78	0,827%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,400%	05/05/2011	05/05/2016	EUR	126.080.670	126.080.670	64,05	0,743%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,400%	03/03/2011	03/03/2016	EUR	82.219.450	82.219.450	65,57	0,722%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	0,352%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	137.971.675	137.971.675	55,63	0,725%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	0,489%	04/08/2011	04/08/2016	EUR	167.982.668	167.982.668	35,86	0,528%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,300%	07/04/2011	07/04/2016	EUR	114.392.000	114.392.000	64,45	0,730%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,750%	16/06/2011	16/06/2016	EUR	24.785.250	24.785.250	60,48	0,741%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	0,438%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	132.927.690	132.927.690	40,34	0,572%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	3,200%	19/05/2011	19/05/2016	EUR	110.865.300	110.865.300	-	0,825%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,000%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	80.409.930	80.409.930	65,58	0,696%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,500%	23/02/2011	23/02/2016	EUR	67.334.330	67.334.330	66,05	0,722%	-	Banks	100,500	GB
Deutsche Bank AG/London	3,000%	02/06/2011	02/06/2016	EUR	77.401.660	77.401.660	-	0,664%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,400%	14/04/2011	14/04/2016	EUR	44.322.876	44.322.876	64,64	0,736%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,750%	23/06/2011	23/06/2016	EUR	14.188.000	14.188.000	60,16	0,743%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,250%	06/01/2011	06/01/2016	EUR	94.064.326	94.064.326	65,90	0,688%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,750%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	71.722.425	71.722.425	-	0,718%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,750%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	38.591.910	38.591.910	-	0,799%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,500%	29/09/2011	29/09/2016	EUR	61.002.936	61.002.936	61,90	0,788%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,000%	02/06/2011	02/06/2016	EUR	74.869.830	74.869.830	61,70	0,742%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,900%	06/01/2011	06/01/2016	EUR	76.345.838	76.345.838	-	0,709%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	3,250%	07/04/2011	07/04/2016	EUR	132.980.700	132.980.700	-	0,759%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,850%	23/06/2011	23/06/2016	EUR	22.417.040	22.417.040	-	0,775%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,850%	16/06/2011	16/06/2016	EUR	29.034.150	29.034.150	-	0,772%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,000%	22/12/2011	22/12/2016	EUR	28.055.780	28.055.780	66,06	0,830%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,250%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	3.125.041	3.125.041	74,29	0,721%	-	Banks	101,750	GB
Deutsche Bank AG/London	2,400%	29/09/2011	29/09/2016	EUR	31.384.584	31.384.584	-	0,798%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,800%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	21.781.440	21.781.440	-	0,825%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,000%	24/11/2011	24/11/2016	EUR	47.624.514	47.624.514	65,53	0,824%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,850%	28/10/2011	28/10/2016	EUR	35.405.000	35.405.000	-	0,821%	-	Banks	100,000	GB

Deutsche Bank AG/London	3,400%	05/05/2011	05/05/2016	EUR	197.502.090	197.502.090	-	0,681%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,250%	19/05/2011	19/05/2016	EUR	74.673.144	74.673.144	73,95	0,853%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	3,150%	03/03/2011	03/03/2016	EUR	73.858.150	73.858.150	-	0,744%	-	Banks	101,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,600%	08/12/2011	08/12/2016	EUR	13.665.915	13.665.915	-	0,830%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank Mutui SpA	0,000%	02/02/2011	02/02/2016	EUR	103.410.750	234.397.700	33,30	0,311%	-	Banks	100,000	IT
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	2,875%	25/01/2011	30/12/2015	EUR	68.209.000	68.209.000	-	0,162%	AAA	Consumer Finance	100,380	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	2,000%	14/09/2011	14/10/2016	EUR	13.714.300	13.714.300	-	0,835%	A+	Consumer Finance	100,600	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	2,750%	16/05/2011	16/06/2016	EUR	14.200.300	14.200.300	-	0,828%	A+	Consumer Finance	99,750	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	2,875%	25/02/2011	29/03/2016	EUR	13.760.200	13.760.200	-	0,236%	AAA	Consumer Finance	99,580	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	2,500%	12/01/2011	12/02/2016	EUR	13.083.000	13.083.000	-	0,785%	A+	Consumer Finance	99,900	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	0,956%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	14.124.000	14.124.000	28,46	0,263%	-	Consumer Finance	99,952	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	2,800%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	11.352.000	11.352.000	30,12	0,349%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	3,000%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	6.758.950	6.758.950	28,93	0,346%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	0,485%	04/10/2011	04/10/2016	EUR	13.274.000	13.274.000	15,44	0,132%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	3,250%	18/04/2011	18/04/2016	EUR	28.476.000	28.476.000	-	0,204%	-	Consumer Finance	99,520	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	2,800%	08/06/2011	08/06/2016	EUR	7.302.550	7.302.550	33,26	0,381%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	0,900%	09/06/2011	09/06/2016	EUR	14.528.400	14.528.400	23,35	0,282%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,486%	16/12/2011	16/12/2016	EUR	39.036.000	39.036.000	143,35	1,412%	BBB	Banks	99,532	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	3,735%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	6.911.500	6.911.500	-	1,467%	BBB	Banks	100,000	DE
Dexia Crediop SpA	4,850%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	369.356.178	369.356.178	-	3,805%	-	Banks	100,000	IT
Dexia Credit Local SA	1,787%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	31.607.400	31.607.400	168,18	1,660%	-	Banks	100,000	FR
Dexia Kommunalbank Deutschland AG	2,750%	18/01/2011	18/01/2016	EUR	816.209.925	1.336.010.000	-	0,029%	A	Consumer Finance	99,880	DE
Dexia Kommunalbank Deutschland AG	2,250%	02/08/2011	02/08/2016	EUR	14.201.700	14.201.700	118,54	1,233%	A	Consumer Finance	100,000	DE
Dexia LdG Banque SA	0,985%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	638.550.000	638.550.000	6,56	0,044%	NR	Banks	99,615	LU
DNB Bank ASA	2,500%	09/03/2011	09/03/2016	EUR	20.850.000	20.850.000	40,73	0,385%	A+	Banks	100,000	NO
DNB Bank ASA	0,823%	27/04/2011	27/04/2016	EUR	36.712.500	36.712.500	24,86	0,297%	A+	Banks	100,000	NO
DNB Boligkreditt AS	2,500%	18/10/2011	18/10/2016	EUR	2.747.880.000	2.747.880.000	-	0,016%	AAA	Banks	99,435	NO
DNB Boligkreditt AS	2,625%	11/01/2011	11/01/2016	EUR	2.593.880.000	2.593.880.000	-	0,003%	AAA	Banks	99,543	NO
DNB Boligkreditt AS	0,387%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	717.860.000	717.860.000	3,78	0,016%	AAA	Banks	100,000	NO
DNB Boligkreditt AS	0,485%	04/10/2011	04/10/2016	EUR	86.281.000	86.281.000	4,74	0,025%	-	Banks	99,856	NO
DNB Boligkreditt AS	0,429%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	73.170.000	73.170.000	14,50	0,193%	AAA	Banks	100,000	NO

DNB Boligkreditt AS	0,341%	10/02/2011	10/02/2016	EUR	34.065.000	34.065.000	25,09	0,229%	-	Banks	100,000	NO
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,000%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	6.806.500	6.806.500	47,85	0,457%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,250%	08/02/2011	08/02/2016	EUR	68.325.000	68.325.000	40,22	0,380%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,191%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	72.854.000	72.854.000	14,35	0,121%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,700%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	33.132.000	33.132.000	-	0,447%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,409%	09/08/2011	09/08/2016	EUR	14.226.000	14.226.000	23,16	0,401%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,375%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	36.239.250	36.239.250	-	0,257%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,000%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	28.375.400	28.375.400	43,94	0,417%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,331%	27/01/2011	27/01/2016	EUR	6.851.000	6.851.000	42,56	0,404%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,250%	29/03/2011	29/03/2016	EUR	70.405.000	70.405.000	40,73	0,385%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,281%	14/11/2011	14/11/2016	EUR	20.431.050	20.431.050	18,70	0,165%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,700%	11/05/2011	11/05/2016	EUR	34.126.080	34.126.080	-	0,454%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,500%	22/02/2011	22/02/2016	EUR	27.316.400	27.316.400	-	0,449%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,300%	08/02/2011	08/02/2016	EUR	27.330.000	27.330.000	-	0,441%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,600%	29/03/2011	29/03/2016	EUR	33.794.400	33.794.400	-	0,447%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	4,470%	24/11/2011	23/12/2016	EUR	66.701.000	66.701.000	-	1,026%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,500%	15/12/2011	15/12/2016	EUR	32.518.750	32.518.750	-	0,440%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,800%	18/11/2011	18/11/2016	EUR	6.757.000	6.757.000	47,54	0,453%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,900%	29/09/2011	29/09/2016	EUR	20.379.600	20.379.600	-	0,224%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,240%	20/10/2011	30/09/2016	EUR	34.269.500	34.269.500	-	0,212%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,500%	26/07/2011	26/07/2016	EUR	7.249.000	7.249.000	-	0,500%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,270%	14/04/2011	14/04/2016	EUR	28.969.200	28.969.200	-	0,447%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,266%	14/03/2011	14/03/2016	EUR	34.974.250	34.974.250	36,34	0,341%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,500%	08/02/2011	08/02/2016	EUR	13.665.000	13.665.000	24,84	0,296%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,500%	18/02/2011	18/02/2016	EUR	13.670.000	13.670.000	21,95	0,267%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,500%	22/07/2011	22/07/2016	EUR	35.912.500	35.912.500	-	0,458%	-	Banks	100,000	DE
DZ Privatbank SA	0,451%	14/11/2011	14/11/2016	EUR	40.862.100	40.862.100	28,44	0,262%	-	Banks	100,000	LU
DZ Privatbank SA	0,385%	29/09/2011	29/09/2016	EUR	27.172.800	27.172.800	28,91	0,267%	-	Banks	100,000	LU
EBS Mortgage Finance	1,927%	25/11/2011	25/11/2016	EUR	198.607.500	397.215.000	38,94	0,315%	-	Consumer Finance	75,000	IE
EDP Finance BV	5,875%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	1.036.725.000	1.036.725.000	-	0,285%	BB+	Utilities	99,381	NL
Emil Banca Credito Cooperativo SC	3,300%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	20.965.500	20.965.500	-	1,238%	-	Banks	100,000	IT

Emil Banca Credito Cooperativo SC	3,300%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	20.203.500	20.203.500	-	1,218%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	3,000%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	28.586.600	28.586.600	121,66	1,265%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	2,000%	17/11/2011	17/11/2016	EUR	8.988.318	8.988.318	127,00	1,318%	-	Banks	100,000	IT
Erste Group Bank AG	4,250%	12/04/2011	12/04/2016	EUR	1.086.337.500	1.086.337.500	-	0,438%	BBB+	Banks	99,722	AT
Erste Group Bank AG	3,250%	17/05/2011	17/05/2016	EUR	31.173.120	31.173.120	76,79	0,746%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	0,351%	20/07/2011	20/07/2016	EUR	49.707.000	49.707.000	4,34	0,021%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	4,125%	15/06/2011	15/06/2016	EUR	2.841.000	2.841.000	-	0,879%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,125%	22/02/2011	22/02/2016	EUR	15.024.020	15.024.020	-	0,398%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	4,250%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	5.685.600	5.685.600	-	0,839%	-	Banks	100,500	AT
Erste Group Bank AG	1,089%	17/06/2011	17/06/2016	EUR	7.147.000	7.147.000	69,87	0,747%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,100%	08/11/2011	08/11/2016	EUR	344.548	344.548	91,86	0,897%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	4,150%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	2.914.160	2.914.160	-	0,869%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,000%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	10.002.329	10.002.329	80,83	0,786%	-	Banks	99,900	AT
Erste Group Bank AG	3,330%	27/04/2011	27/04/2016	EUR	4.405.500	4.405.500	-	0,829%	-	Banks	99,000	AT
Erste Group Bank AG	2,500%	18/02/2011	18/02/2016	EUR	7.791.900	7.791.900	42,31	0,401%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	4,500%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	9.462.530	9.462.530	-	0,815%	-	Banks	100,500	AT
Erste Group Bank AG	4,000%	31/01/2011	31/01/2016	EUR	5.478.800	5.478.800	-	0,822%	-	Banks	100,700	AT
Erste Group Bank AG	3,000%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	3.494.250	3.494.250	85,19	0,830%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,186%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	5.649.600	5.649.600	76,42	0,742%	-	Banks	100,000	AT
Eurofoam GmbH	4,102%	25/07/2011	25/07/2016	EUR	57.492.000	57.492.000	-	0,577%	-	Chemicals	100,000	AT
Evangelische Bank eG	3,150%	24/05/2011	24/05/2016	EUR	28.178.800	28.178.800	-	0,495%	-	Banks	100,000	DE
EYEMAXX Real Estate AG	7,500%	26/07/2011	26/07/2016	EUR	36.245.000	36.245.000	-	3,681%	-	Financial Services	100,000	DE
Fairvesta Europe II AG	4,200%	12/01/2011	12/01/2016	EUR	65.415.000	65.415.000	-	0,300%	-	Real Estate	105,000	LI
Farbanca SpA	1,278%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	7.220.500	7.220.500	111,33	1,161%	-	Banks	100,000	IT
Fiat Chrysler Finance Europe	6,375%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	1.421.400.000	1.421.400.000	-	1,341%	BB-	Automobiles Manufacturing	100,000	LU
FMC Finance VIII SA	3,481%	17/10/2011	15/10/2016	EUR	137.707.000	137.707.000	66,51	0,643%	BB+	Health Care Facilities & Services	100,000	DE
FMS Wertmanagement AoER	0,000%	24/05/2011	24/05/2016	EUR	8.453.640	8.453.640	-	0,172%	AAA	Winding Up Agencies	86,550	DE
Fondo de Reestructuración Ordenada Bancaria	5,500%	12/07/2011	12/07/2016	EUR	3.509.254.500	3.509.254.500	-	0,138%	BBB	Government Agencies	99,889	ES
Frankfurter Sparkasse	2,900%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	14.393.500	14.393.500	-	0,530%	-	Banks	100,000	DE
Frauenthal Holding AG	4,875%	20/05/2011	20/05/2016	EUR	130.590.320	141.946.000	-	1,841%	-	Retail - Consumer Discretionary	101,192	AT

Freenet AG	7,125%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	579.828.000	579.828.000	-	1,331%	-	Wireless Telecommunications Services	99,491	DE
GEA Group AG	4,250%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	400.316.702	582.832.000	-	0,272%	-	Machinery Manufacturing	99,656	DE
Gecina SA	4,250%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	682.460.000	682.460.000	-	0,255%	BBB+	Real Estate	99,348	FR
Geno Bank Essen eG	2,500%	01/08/2011	01/08/2016	EUR	7.119.350	7.119.350	-	0,545%	-	Banks	99,760	DE
GFK SE	5,000%	14/04/2011	14/04/2016	EUR	269.583.030	289.692.000	-	0,739%	-	Software & Services	99,250	DE
GIF - Gesellschaft für Industrieforschung mbH	8,500%	20/09/2011	20/09/2016	EUR	20.514.000	20.514.000	-	3,031%	-	Health Care Facilities & Services	100,000	DE
Groupe Auchan SA	3,000%	29/11/2011	02/12/2016	EUR	799.794.000	799.794.000	-	0,170%	A-	Supermarkets & Pharmacies	99,867	FR
Hamburger Sparkasse AG	3,125%	17/05/2011	17/05/2016	EUR	141.696.000	141.696.000	-	0,160%	-	Banks	100,380	DE
Hamburger Sparkasse AG	4,000%	20/06/2011	20/06/2016	EUR	27.177.600	27.177.600	-	0,599%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	2,250%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	16.601.668	71.466.500	-	0,476%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	3,000%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	4.986.932	71.466.500	-	0,550%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	2,500%	04/01/2011	04/01/2016	EUR	17.557.172	66.570.000	-	0,419%	-	Banks	100,750	DE
Hamburger Sparkasse AG	3,000%	02/05/2011	02/05/2016	EUR	27.774.220	74.370.000	-	0,451%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	2,000%	06/05/2011	06/05/2016	EUR	15.396.644	37.443.900	44,49	0,423%	-	Banks	100,000	DE
Holzwerkstoffe Vertriebsholding AG	5,083%	11/11/2011	11/11/2016	EUR	27.495.400	27.495.400	-	0,680%	-	Construction Materials Manufacturing	100,000	AT
HSBC Bank PLC	1,900%	15/12/2011	15/12/2016	EUR	1.951.125	1.951.125	88,70	0,865%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	0,648%	22/08/2011	22/08/2016	EUR	11.509.920	11.509.920	74,93	0,727%	-	Banks	99,810	GB
HSBC Bank PLC	0,991%	09/11/2011	09/11/2016	EUR	3.099.333	3.099.333	82,09	0,799%	-	Banks	100,000	GB
HSBC France SA	0,885%	28/03/2011	29/03/2016	EUR	176.212.500	176.212.500	22,05	0,199%	-	Banks	100,000	FR
HSBC Holdings PLC	3,875%	16/03/2011	16/03/2016	EUR	1.180.616.000	1.180.616.000	-	0,108%	A	Diversified Banks	99,910	GB
HSH Nordbank AG	2,500%	29/12/2011	29/12/2016	EUR	2.588.320	2.588.320	45,97	0,629%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	0,367%	08/06/2011	08/06/2016	EUR	14.605.100	14.605.100	57,44	0,552%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	3,800%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	3.494.250	3.494.250	-	0,606%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	0,411%	26/10/2011	26/10/2016	EUR	13.830.400	13.830.400	56,28	0,541%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	3,000%	25/05/2011	25/05/2016	EUR	28.210.000	28.210.000	36,73	0,486%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	0,000%	04/11/2011	04/11/2016	EUR	2.758.840	2.758.840	120,91	1,187%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	3,000%	29/08/2011	29/08/2016	EUR	35.247.150	36.262.500	51,40	0,492%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,184%	18/05/2011	18/05/2016	EUR	7.129.750	7.129.750	43,73	0,485%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	0,678%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	722.050	722.050	51,35	0,561%	-	Banks	100,000	DE

HSB Nordbank AG	3,000%	19/01/2011	19/01/2016	EUR	66.523.800	68.748.000	-	0,453%	-	Banks	100,000	DE
HSB Nordbank AG	2,500%	23/02/2011	22/02/2016	EUR	12.917.198	13.741.700	52,41	0,502%	-	Banks	100,000	DE
HSB Nordbank AG	4,000%	03/03/2011	03/03/2016	EUR	102.768.738	110.090.450	-	0,465%	-	Banks	100,000	DE
HSB Nordbank AG	4,000%	17/02/2011	17/02/2016	EUR	42.006.078	43.501.440	-	0,501%	-	Banks	100,000	DE
HSB Nordbank AG	4,000%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	46.251.902	48.238.180	-	0,504%	-	Banks	100,000	DE
HSB Nordbank AG	3,108%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	6.758.950	6.758.950	-	0,393%	-	Banks	100,000	DE
HSB Nordbank AG	2,250%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	19.108.880	20.473.800	47,51	0,453%	-	Banks	100,000	DE
Hypo Alpe-Adria-Bank SpA	0,061%	05/05/2011	05/05/2016	EUR	14.336.757	21.863.700	534,55	5,393%	-	Banks	100,000	IT
Hypo Alpe-Adria-Bank SpA	0,166%	20/06/2011	20/06/2016	EUR	16.428.144	21.456.000	530,60	5,445%	-	Banks	100,000	IT
HYPO NOE Landesbank AG	3,250%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	17.946.500	17.946.500	-	0,562%	-	Consumer Finance	100,000	AT
HYPO NOE Landesbank AG	2,500%	02/11/2011	02/11/2016	EUR	6.873.400	6.873.400	-	0,572%	-	Consumer Finance	100,000	AT
Hypo Tirol Bank AG	0,000%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	13.823.000	13.823.000	-	2,282%	-	Consumer Finance	86,000	AT
Hypothenkenbank Frankfurt AG	2,875%	19/01/2011	19/01/2016	EUR	940.073.632	1.685.000.000	-	0,027%	NR	Banks	99,725	DE
Hypothenkenbank Frankfurt AG	3,000%	25/01/2011	25/01/2016	EUR	6.820.900	6.820.900	123,83	1,216%	NR	Banks	100,000	DE
Iccrea Banca SpA	4,150%	01/04/2011	01/04/2016	EUR	483.759.276	483.759.276	11,66	0,165%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	4,000%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	122.321.691	174.129.600	79,99	0,848%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	1,059%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	1.704.036	1.704.036	86,47	0,913%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	5,000%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	2.130.045	2.130.045	-	0,068%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	1,088%	03/10/2011	03/10/2016	EUR	38.474.590	38.474.590	48,02	0,528%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca Impresa SpA	1,436%	06/05/2011	01/04/2016	EUR	462.432.165	462.432.165	145,64	1,434%	-	Consumer Finance	100,000	IT
Iliad SA	4,875%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	719.675.000	719.675.000	-	0,666%	-	Wireline Telecommunications Services	99,532	FR
Immigon Portfolioabbau AG	5,000%	18/03/2011	18/03/2016	EUR	47.594.736	47.594.736	-	7,589%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	4,050%	19/08/2011	19/08/2016	EUR	8.639.940	8.639.940	-	9,916%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	5,000%	30/05/2011	30/05/2016	EUR	14.277.000	14.277.000	-	8,834%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	4,700%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	42.851.300	42.851.300	-	6,872%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	3,100%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	8.973.250	8.973.250	728,46	7,263%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	3,500%	12/12/2011	12/12/2016	EUR	3.960.960	3.960.960	-	11,114%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	1,236%	14/06/2011	14/06/2016	EUR	4.341.510	4.341.510	891,94	9,054%	-	Banks	100,000	AT
ING Bank NV	3,875%	24/05/2011	24/05/2016	EUR	2.113.410.000	2.113.410.000	-	0,144%	A	Banks	99,675	NL
ING Bank NV	4,000%	23/12/2011	23/12/2016	EUR	569.003.999	569.003.999	-	0,206%	A	Banks	100,000	NL

ING Bank NV	0,000%	28/09/2011	28/09/2016	EUR	11.570.200	11.570.200	43,35	0,412%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	0,000%	05/10/2011	05/10/2016	EUR	39.932.400	39.932.400	55,61	0,534%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,096%	28/09/2011	28/09/2016	EUR	3.403.000	3.403.000	57,88	0,505%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,137%	30/05/2011	30/05/2016	EUR	28.554.000	28.554.000	49,62	0,474%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	2,250%	20/10/2011	20/10/2016	EUR	4.112.340	4.112.340	53,07	0,509%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	2,800%	28/04/2011	28/04/2016	EUR	4.438.800	4.438.800	51,51	0,493%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	3,125%	28/12/2011	28/12/2016	EUR	45.282.650	45.282.650	-	0,497%	-	Banks	99,700	NL
ING Bank NV	1,117%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	35.983.750	35.983.750	37,52	0,353%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	3,750%	12/10/2011	12/10/2016	EUR	6.905.450	6.905.450	-	0,570%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	2,750%	22/03/2011	22/03/2016	EUR	7.109.000	7.109.000	49,26	0,471%	A	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	3,000%	25/11/2011	25/11/2016	EUR	10.592.400	10.592.400	51,93	0,497%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	3,250%	14/10/2011	14/10/2016	EUR	27.695.000	27.695.000	-	0,498%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,067%	10/06/2011	30/05/2016	EUR	4.485.000	4.485.000	39,66	0,519%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	3,000%	15/06/2011	15/06/2016	EUR	35.512.500	35.512.500	43,93	0,417%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	4,100%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	8.706.240	8.706.240	-	0,599%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	2,750%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	1.412.400	1.412.400	43,52	0,513%	-	Banks	100,000	NL
ING Belgium International Finance SA	2,750%	30/03/2011	30/03/2016	EUR	16.842.430	16.842.430	48,16	0,460%	-	Financial Services	100,000	LU
ING Belgium International Finance SA	3,200%	06/01/2011	06/01/2016	EUR	4.364.481	4.364.481	-	0,521%	-	Financial Services	100,000	LU
Instituto de Credito Oficial	5,125%	25/01/2011	25/01/2016	EUR	4.740.525.500	4.774.630.000	-	0,089%	BBB	Government Agencies	99,897	ES
Instituto de Credito Oficial	4,930%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	335.448.000	335.448.000	-	2,591%	BBB	Government Agencies	100,000	ES
Intesa Sanpaolo SpA	4,125%	14/01/2011	14/01/2016	EUR	1.601.760.000	1.601.760.000	-	0,356%	BBB-	Banks	99,597	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,280%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	71.910.000	71.910.000	100,13	0,979%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,000%	04/07/2011	04/07/2016	EUR	87.141.529	87.141.529	96,72	0,945%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	0,995%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	140.382.830	140.382.830	81,05	0,789%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,000%	05/12/2011	05/12/2016	EUR	21.637.542	21.637.542	118,76	1,166%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	6,000%	28/12/2011	28/12/2016	EUR	278.411.964	278.411.964	89,42	0,872%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,200%	12/09/2011	12/09/2016	EUR	21.109.900	21.109.900	125,34	1,231%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,400%	04/11/2011	04/11/2016	EUR	68.463.373	68.463.373	130,97	1,288%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	3,280%	05/10/2011	05/10/2016	EUR	16.595.905	16.595.905	73,53	0,713%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,336%	28/11/2011	20/12/2016	EUR	66.563.500	66.563.500	138,02	1,358%	BBB-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,437%	09/06/2011	09/06/2016	EUR	14.528.400	14.528.400	91,86	0,897%	BBB-	Banks	100,000	IT

Investitionsbank Berlin	2,800%	27/01/2011	27/01/2016	EUR	137.020.000	137.020.000	-	0,120%	-	Government Development Banks	99,848	DE
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4,750%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	22.169.760.200	22.169.760.200	-	0,032%	-	Sovereigns	96,650	IT
Junta de Castilla y Leon	4,750%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	85.201.800	85.201.800	-	0,282%	-	Government Regional	100,000	ES
Jyske Bank A/S	1,387%	07/06/2011	07/06/2016	EUR	29.358.200	29.358.200	30,75	0,285%	-	Banks	99,765	DK
KBC IFIMA SA	5,000%	16/03/2011	16/03/2016	EUR	916.713.600	1.041.720.000	-	0,147%	A	Banks	99,577	LU
KBC IFIMA SA	1,512%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	20.113.800	20.113.800	40,74	0,385%	-	Banks	100,000	LU
KBC IFIMA SA	3,200%	18/01/2011	18/01/2016	EUR	4.008.030	4.008.030	49,40	0,472%	-	Banks	100,000	LU
Koleje Mazowieckie Finance AB	6,750%	09/03/2011	09/03/2016	EUR	139.000.000	139.000.000	-	0,903%	-	Transportation & Logistics	99,486	SE
Kommunalkredit Austria AG	3,500%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	675.895.000	675.895.000	-	0,240%	-	Banks	99,721	AT
Kreissparkasse Boeblingen	2,900%	09/03/2011	09/03/2016	EUR	13.900.000	13.900.000	-	0,521%	-	Banks	99,420	DE
Kreissparkasse Koeln	2,875%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	83.810.980	83.810.980	-	0,092%	-	Banks	99,510	DE
Kreissparkasse Koeln	0,266%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	26.898.000	26.898.000	5,49	0,224%	-	Banks	100,000	DE
Kutxabank SA	4,400%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	646.488.150	646.488.150	-	0,531%	-	Banks	100,000	ES
Laehitapiola Pankki Oyj	1,512%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	21.765.600	21.765.600	20,17	0,349%	-	Banks	100,000	FI
Landesbank Berlin AG	0,581%	09/06/2011	09/06/2016	EUR	29.056.800	29.056.800	12,10	0,251%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,900%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	4.371.240	4.371.240	63,03	0,608%	-	Banks	100,750	DE
Landesbank Berlin AG	3,100%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	74.253.000	74.253.000	-	0,231%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,000%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	12.211.950	12.211.950	59,92	0,577%	-	Banks	100,750	DE
Landesbank Berlin AG	1,750%	18/10/2011	18/10/2016	EUR	137.394.000	137.394.000	-	0,445%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,500%	27/05/2011	27/05/2016	EUR	20.046.180	20.046.180	59,12	0,569%	-	Banks	102,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,125%	28/04/2011	28/04/2016	EUR	29.592.000	44.388.000	-	0,273%	-	Banks	99,860	DE
Landesbank Berlin AG	0,237%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	21.439.950	21.439.950	16,65	0,144%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,100%	26/07/2011	26/07/2016	EUR	4.349.400	4.349.400	62,12	0,599%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,250%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	8.895.600	8.895.600	46,49	0,563%	-	Banks	101,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	136.130.000	136.130.000	42,92	0,407%	-	Banks	100,750	DE
Landesbank Berlin AG	3,200%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	9.529.100	9.529.100	-	0,575%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,000%	04/04/2011	04/04/2016	EUR	17.058.600	17.058.600	-	0,553%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,500%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	143.670.000	143.670.000	-	0,482%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,300%	20/09/2011	20/09/2016	EUR	6.838.000	6.838.000	-	0,589%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,297%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	1.449.570	1.449.570	165,64	2,274%	-	Banks	102,000	DE

Landesbank Berlin AG	1,500%	29/11/2011	29/11/2016	EUR	133.299.000	133.299.000	45,59	0,434%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,000%	13/12/2011	13/12/2016	EUR	6.541.350	6.541.350	-	0,586%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	134.490.000	134.490.000	44,78	0,426%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,656%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	35.994.000	35.994.000	47,98	0,458%	-	Banks	99,860	DE
Landesbank Berlin AG	1,000%	31/10/2011	31/10/2016	EUR	2.789.220	2.789.220	60,46	0,583%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,200%	18/11/2011	18/11/2016	EUR	6.757.000	6.757.000	-	0,590%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,800%	23/08/2011	23/08/2016	EUR	4.326.990	4.326.990	-	0,623%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,000%	23/08/2011	23/08/2016	EUR	2.884.660	2.884.660	62,93	0,607%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,600%	31/08/2011	31/08/2016	EUR	12.969.000	12.969.000	-	0,571%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,750%	12/04/2011	12/04/2016	EUR	72.422.500	72.422.500	-	0,513%	-	Banks	100,030	DE
Landesbank Berlin AG	2,600%	30/05/2011	30/05/2016	EUR	37.120.200	37.120.200	54,61	0,524%	-	Banks	101,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,300%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	7.413.000	7.413.000	-	0,602%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,250%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	11.608.320	11.608.320	-	0,588%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,500%	28/06/2011	28/06/2016	EUR	143.547.000	143.547.000	-	0,485%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,250%	28/06/2011	28/06/2016	EUR	7.177.350	7.177.350	61,27	0,591%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,500%	14/04/2011	14/04/2016	EUR	144.846.000	144.846.000	35,76	0,447%	-	Banks	101,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,500%	17/03/2011	17/03/2016	EUR	105.078.000	105.078.000	-	0,486%	-	Banks	99,780	DE
Landesbank Berlin AG	3,000%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	17.791.200	17.791.200	-	0,555%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,260%	14/06/2011	14/06/2016	EUR	159.188.700	159.188.700	-	0,465%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,100%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	42.795.500	42.795.500	-	0,511%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	4,500%	08/02/2011	08/02/2016	EUR	6.832.500	6.832.500	-	0,629%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,000%	18/01/2011	18/01/2016	EUR	66.800.500	66.800.500	-	0,478%	-	Banks	99,570	DE
Landesbank Berlin AG	2,900%	23/02/2011	23/02/2016	EUR	44.660.525	48.095.950	-	0,261%	-	Banks	100,080	DE
Landesbank Berlin AG	2,800%	04/02/2011	04/02/2016	EUR	9.505.860	9.505.860	-	0,565%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,500%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	143.670.000	143.670.000	-	0,482%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,500%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	143.670.000	143.670.000	47,92	0,457%	-	Banks	101,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,200%	30/03/2011	30/03/2016	EUR	11.300.800	11.300.800	-	0,575%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,687%	07/06/2011	07/06/2016	EUR	73.395.500	73.395.500	44,93	0,427%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	27/12/2011	27/12/2016	EUR	130.737.000	130.737.000	45,70	0,435%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,695%	05/08/2011	05/08/2016	EUR	71.226.500	71.226.500	44,95	0,428%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,000%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	25.887.600	25.887.600	-	0,550%	-	Banks	100,000	DE

Landesbank Berlin AG	3,375%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	72.073.500	72.073.500	-	0,511%	-	Banks	100,540	DE
Landesbank Berlin AG	3,250%	26/07/2011	26/07/2016	EUR	7.249.000	7.249.000	-	0,612%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,549%	01/08/2011	01/08/2016	EUR	106.790.250	106.790.250	24,25	0,411%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,500%	14/04/2011	14/04/2016	EUR	144.846.000	144.846.000	31,31	0,403%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,375%	18/03/2011	18/03/2016	EUR	354.127.500	354.127.500	-	0,201%	-	Banks	99,710	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	4,250%	20/05/2011	20/05/2016	EUR	709.730.000	709.730.000	-	0,154%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,200%	20/07/2011	20/07/2016	EUR	71.010.000	71.010.000	42,89	0,477%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	29/12/2011	29/12/2016	EUR	64.708.000	64.708.000	71,01	0,817%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,250%	17/08/2011	17/08/2016	EUR	144.392.000	144.392.000	37,89	0,427%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,500%	02/03/2011	02/03/2016	EUR	138.645.000	138.645.000	37,51	0,423%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,099%	13/07/2011	13/07/2016	EUR	42.449.700	42.449.700	37,91	0,427%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,500%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	144.147.000	144.147.000	127,26	1,380%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,250%	17/08/2011	17/08/2016	EUR	144.392.000	144.392.000	76,31	0,870%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,000%	19/01/2011	19/01/2016	EUR	337.000.000	337.000.000	-	0,165%	-	Banks	100,230	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,000%	05/01/2011	05/01/2016	EUR	131.830.000	131.830.000	32,98	0,358%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,099%	21/12/2011	21/12/2016	EUR	6.535.250	6.535.250	46,46	0,513%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,250%	28/04/2011	28/04/2016	EUR	147.960.000	147.960.000	94,36	1,051%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,000%	14/09/2011	14/09/2016	EUR	137.143.000	137.143.000	38,24	0,430%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,250%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	337.947.500	337.947.500	-	0,151%	-	Banks	99,390	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	21/09/2011	21/09/2016	EUR	137.408.000	137.408.000	77,73	0,884%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,000%	18/11/2011	30/11/2016	EUR	27.028.000	27.028.000	-	0,416%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,150%	16/06/2011	16/06/2016	EUR	70.815.000	70.815.000	32,51	0,461%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,500%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	144.147.000	144.147.000	40,47	0,453%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,000%	30/03/2011	30/03/2016	EUR	141.260.000	141.260.000	39,84	0,446%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,186%	20/09/2011	20/09/2016	EUR	54.704.000	54.704.000	43,68	0,415%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,000%	05/01/2011	05/01/2016	EUR	131.830.000	131.830.000	128,14	1,388%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,000%	30/03/2011	30/03/2016	EUR	141.260.000	141.260.000	96,98	1,077%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,200%	20/07/2011	20/07/2016	EUR	71.010.000	71.010.000	78,98	0,897%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	14/12/2011	14/12/2016	EUR	64.967.500	64.967.500	40,55	0,454%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,500%	12/08/2011	12/08/2016	EUR	71.175.000	71.175.000	46,94	0,447%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,678%	17/10/2011	17/10/2016	EUR	137.707.000	137.707.000	18,31	0,352%	-	Banks	99,953	DE

Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	16/11/2011	16/11/2016	EUR	67.611.500	67.611.500	75,95	0,866%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	19/10/2011	19/10/2016	EUR	0	68.931.000	80,72	0,855%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,649%	28/12/2011	28/12/2016	EUR	323.447.500	323.447.500	14,23	0,190%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,158%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	34.910.000	34.910.000	36,71	0,415%	-	Banks	99,990	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,250%	17/03/2011	17/03/2016	EUR	140.104.000	140.104.000	31,74	0,392%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	14/12/2011	14/12/2016	EUR	64.967.500	64.967.500	70,14	0,806%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,250%	25/05/2011	25/05/2016	EUR	141.050.000	141.050.000	89,95	1,007%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	19/10/2011	19/10/2016	EUR	68.931.000	68.931.000	74,91	0,856%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,000%	06/12/2011	06/12/2016	EUR	40.190.100	40.190.100	-	0,400%	-	Banks	99,770	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,099%	07/12/2011	15/12/2016	EUR	6.712.000	6.712.000	46,42	0,512%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,230%	09/12/2011	09/12/2016	EUR	133.696.000	133.696.000	-	0,356%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	29/12/2011	29/12/2016	EUR	64.708.000	64.708.000	40,50	0,453%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,099%	21/12/2011	21/12/2016	EUR	32.676.250	32.676.250	39,49	0,443%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,581%	09/11/2011	09/11/2016	EUR	13.605.500	13.605.500	42,03	0,468%	-	Banks	99,850	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,169%	25/08/2011	25/08/2016	EUR	35.923.750	35.923.750	38,77	0,436%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	21/09/2011	21/09/2016	EUR	137.408.000	137.408.000	36,97	0,418%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,099%	07/07/2011	07/07/2016	EUR	7.173.050	7.173.050	45,54	0,503%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,139%	26/09/2011	26/09/2016	EUR	26.921.800	26.921.800	40,22	0,450%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,755%	07/10/2011	07/10/2016	EUR	133.923.000	133.923.000	38,75	0,366%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	16/11/2011	16/11/2016	EUR	67.611.500	67.611.500	39,97	0,448%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	02/09/2011	02/09/2016	EUR	71.015.000	71.015.000	47,25	0,450%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,500%	24/06/2011	24/06/2016	EUR	70.868.500	70.868.500	43,44	0,482%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,100%	16/06/2011	16/06/2016	EUR	28.326.000	28.326.000	38,87	0,437%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	3,790%	16/06/2011	16/06/2016	EUR	28.326.000	28.326.000	-	0,400%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	4,500%	08/02/2011	08/02/2016	EUR	27.330.000	27.330.000	-	0,406%	-	Banks	102,520	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,500%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	67.589.500	67.589.500	39,43	0,442%	-	Banks	102,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,118%	21/10/2011	21/10/2016	EUR	27.711.400	27.711.400	40,10	0,449%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,148%	16/09/2011	16/09/2016	EUR	34.493.500	34.493.500	38,84	0,436%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,200%	02/02/2011	02/02/2016	EUR	137.881.000	137.881.000	57,65	0,626%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Saar	0,721%	15/04/2011	15/04/2016	EUR	36.102.500	36.102.500	28,92	0,267%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Saar	2,600%	06/10/2011	06/10/2016	EUR	66.979.000	66.979.000	-	0,337%	-	Banks	99,920	DE

Landesbank Saar	3,000%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	37.126.500	37.126.500	-	0,303%	-	Banks	99,400	DE
Landes-Hypothekenbank Steiermark AG	6,070%	27/07/2011	27/07/2016	EUR	14.363.000	14.363.000	-	2,120%	-	Banks	100,000	AT
Landessparkasse zu Oldenburg	3,000%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	9.554.440	9.554.440	-	0,513%	-	Banks	99,100	DE
Landessparkasse zu Oldenburg	3,000%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	9.783.900	9.783.900	-	0,516%	-	Banks	98,450	DE
Landessparkasse zu Oldenburg	3,000%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	7.220.000	7.220.000	-	0,536%	-	Banks	97,750	DE
LBBW	1,186%	17/02/2011	20/03/2016	EUR	20.391.300	20.391.300	181,87	1,797%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,650%	20/07/2011	20/07/2016	EUR	142.020.000	142.020.000	103,21	1,177%	-	Banks	100,750	DE
LBBW	3,000%	19/05/2011	19/05/2016	EUR	142.980.474	143.052.000	87,70	1,022%	-	Banks	101,250	DE
LBBW	0,524%	10/08/2011	10/08/2016	EUR	141.900.000	141.900.000	84,88	0,993%	-	Banks	101,000	DE
LBBW	3,050%	14/07/2011	14/07/2016	EUR	141.590.000	141.590.000	-	0,309%	-	Banks	100,500	DE
LBBW	0,573%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	7.255.400	7.255.400	7,64	0,224%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,000%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	137.567.760	141.240.000	105,53	1,200%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,500%	07/07/2011	07/07/2016	EUR	143.461.000	143.461.000	116,84	1,146%	-	Banks	100,750	DE
LBBW	2,150%	13/10/2011	13/10/2016	EUR	137.449.000	137.449.000	-	0,305%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	4,000%	16/02/2011	16/02/2016	EUR	135.477.000	135.477.000	-	0,316%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	4,000%	13/05/2011	13/05/2016	EUR	141.168.000	141.168.000	-	0,327%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,000%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	143.935.000	143.935.000	126,34	1,241%	-	Banks	101,000	DE
LBBW	3,100%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	144.147.000	144.147.000	-	0,307%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,000%	04/08/2011	04/08/2016	EUR	141.638.000	141.638.000	-	0,311%	-	Banks	100,500	DE
LBBW	4,000%	10/03/2011	10/03/2016	EUR	138.200.000	138.200.000	-	0,319%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,250%	22/02/2011	22/02/2016	EUR	136.582.000	136.582.000	182,80	1,806%	-	Banks	101,000	DE
LBBW	2,500%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	145.708.000	145.708.000	93,99	1,085%	-	Banks	101,000	DE
LBBW	4,250%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	146.340.000	146.340.000	-	0,333%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	4,000%	30/03/2011	01/04/2016	EUR	141.260.000	141.260.000	-	0,321%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,500%	29/12/2011	29/12/2016	EUR	129.416.000	129.416.000	-	0,317%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,601%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	14.570.800	14.570.800	20,02	0,178%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,750%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	144.147.000	144.147.000	78,03	0,925%	-	Banks	100,750	DE
LBBW	2,750%	03/08/2011	03/08/2016	EUR	143.020.000	143.020.000	103,71	1,182%	-	Banks	101,250	DE
LBBW	2,680%	05/12/2011	30/12/2016	EUR	134.520.000	134.520.000	-	0,322%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,661%	11/11/2011	11/11/2016	EUR	13.747.700	13.747.700	16,58	0,214%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,671%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	20.173.500	20.173.500	0,12	0,170%	-	Banks	100,000	DE

LBBW	2,500%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	141.240.000	141.240.000	5,82	0,136%	-	Banks	100,500	DE
LBBW	2,500%	19/05/2011	19/05/2016	EUR	143.052.000	143.052.000	2,78	0,142%	-	Banks	100,500	DE
LBBW	4,000%	01/06/2011	03/06/2016	EUR	143.935.000	143.935.000	-	0,330%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,500%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	144.957.000	144.957.000	4,97	0,143%	-	Banks	100,500	DE
LBBW	0,674%	22/03/2011	22/03/2016	EUR	14.218.000	14.218.000	13,35	0,182%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,657%	17/02/2011	17/02/2016	EUR	6.797.100	6.797.100	16,67	0,215%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	4,000%	26/01/2011	26/01/2016	EUR	136.832.000	136.832.000	-	0,329%	-	Banks	100,500	DE
LBBW	2,000%	26/01/2011	26/01/2016	EUR	136.832.000	136.832.000	7,90	0,124%	-	Banks	100,500	DE
LBBW	0,676%	21/11/2011	21/11/2016	EUR	20.260.050	20.260.050	0,38	0,173%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,687%	06/06/2011	06/06/2016	EUR	146.030.000	146.030.000	11,52	0,093%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,000%	24/06/2011	24/06/2016	EUR	35.434.250	35.434.250	-	0,274%	-	Banks	98,569	DE
LBBW	3,000%	09/06/2011	09/06/2016	EUR	145.284.000	145.284.000	83,37	0,978%	-	Banks	100,750	DE
LBBW	3,500%	08/06/2011	08/06/2016	EUR	146.051.000	146.051.000	-	0,316%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,808%	01/08/2011	01/08/2016	EUR	7.119.350	7.119.350	18,04	0,228%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,000%	24/05/2011	24/05/2016	EUR	35.223.500	35.223.500	-	0,177%	-	Banks	99,960	DE
LBBW	2,500%	16/12/2011	16/12/2016	EUR	130.120.000	130.120.000	-	0,314%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,000%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	136.134.000	136.134.000	-	0,320%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,000%	25/08/2011	25/08/2016	EUR	143.695.000	143.695.000	-	0,317%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,000%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	142.933.000	142.933.000	-	0,318%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	4,000%	23/05/2011	23/05/2016	EUR	7.020.500	7.020.500	-	0,458%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,125%	26/01/2011	15/02/2016	EUR	34.208.000	34.208.000	-	0,299%	-	Banks	99,040	DE
LBBW	3,000%	18/01/2011	18/01/2016	EUR	133.601.000	133.601.000	-	0,189%	-	Banks	99,950	DE
LBBW	2,500%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	136.134.000	136.134.000	-	0,307%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,500%	22/09/2011	22/09/2016	EUR	135.010.000	135.010.000	-	0,310%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,400%	07/12/2011	07/12/2016	EUR	134.240.000	134.240.000	-	0,310%	-	Banks	100,000	DE
LeasePlan Corp NV	4,750%	22/12/2011	22/12/2016	EUR	52.196.800	52.196.800	-	1,528%	BBB /*-	Commercial Finance	102,000	NL
LFA Foerderbank Bayern	0,211%	12/10/2011	12/10/2016	EUR	13.810.900	13.810.900	0,42	0,052%	-	Government Development B.	100,000	DE
Lloyds Bank PLC	4,125%	06/04/2011	06/04/2016	EUR	2.506.525.000	2.506.525.000	-	0,011%	-	Banks	99,832	GB
Lloyds Bank PLC	2,057%	11/03/2011	11/03/2016	EUR	55.511.600	55.511.600	32,62	0,304%	A	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	3,700%	18/02/2011	18/02/2016	EUR	3.964.300	3.964.300	47,93	0,457%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	1,607%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	11.493.600	11.493.600	40,07	0,379%	-	Banks	100,000	GB

Lloyds Bank PLC	3,650%	10/02/2011	10/02/2016	EUR	4.224.060	4.224.060	49,19	0,470%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	3,650%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	2.729.840	2.729.840	50,45	0,482%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	3,360%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	1.414.800	1.414.800	55,52	0,533%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	3,000%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	2.051.658	2.051.658	53,95	0,518%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	3,550%	14/10/2011	14/10/2016	EUR	3.226.468	3.226.468	56,41	0,542%	-	Banks	100,000	GB
Mainzer Volksbank	3,045%	29/06/2011	29/06/2016	EUR	21.632.250	21.632.250	-	0,438%	-	Banks	100,000	DE
Mediobanca SpA	0,000%	20/06/2011	20/06/2016	EUR	1.072.800.000	1.072.800.000	-	1,016%	BBB-	Banks	81,270	IT
Mediobanca SpA	3,700%	16/08/2011	16/08/2016	EUR	15.845.610	15.845.610	-	1,212%	BBB-	Banks	100,000	IT
Mediocredito Trentino Alto Adige SpA	1,561%	10/05/2011	10/05/2016	EUR	1.148.480	1.148.480	209,99	2,148%	-	Banks	100,000	IT
MM Warburg & Co Hypothekenbank AG	3,000%	03/03/2011	03/03/2016	EUR	13.935.500	13.935.500	-	0,312%	-	Consumer Finance	99,910	DE
MS Spaichingen GmbH	7,250%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	32.540.400	42.444.000	-	1,812%	-	Auto Parts Manufacturing	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	2,850%	06/06/2011	06/06/2016	EUR	21.904.500	21.904.500	-	0,180%	-	Consumer Finance	99,960	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,478%	18/08/2011	18/08/2016	EUR	143.200.000	143.200.000	17,31	0,221%	-	Consumer Finance	99,856	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	2,500%	06/06/2011	06/06/2016	EUR	21.904.500	21.904.500	21,41	0,192%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,433%	01/08/2011	01/08/2016	EUR	14.238.700	14.238.700	9,19	0,140%	-	Consumer Finance	99,945	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,485%	04/10/2011	04/10/2016	EUR	13.274.000	13.274.000	13,76	0,116%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,161%	12/05/2011	12/05/2016	EUR	28.464.000	28.464.000	2,43	0,072%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	3,125%	31/03/2011	26/02/2016	EUR	56.760.000	56.760.000	-	0,145%	-	Consumer Finance	100,500	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	3,000%	27/05/2011	27/05/2016	EUR	14.318.700	14.318.700	-	0,203%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	2,070%	27/10/2011	30/09/2016	EUR	35.459.500	35.459.500	-	0,144%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Nationwide Building Society	3,125%	13/10/2011	13/10/2016	EUR	2.061.735.000	2.061.735.000	-	0,008%	AAA	Banks	99,545	GB
Nationwide Building Society	1,337%	08/06/2011	08/06/2016	EUR	11.684.080	11.684.080	46,50	0,443%	-	Banks	100,000	GB
Natixis SA	3,000%	13/04/2011	29/04/2016	EUR	1.738.323	1.738.323	55,83	0,536%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Natixis SA	3,250%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	551.684	551.684	59,97	0,578%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Natixis SA	3,250%	08/03/2011	08/03/2016	EUR	1.390.800	1.390.800	56,30	0,541%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Nederlandse Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	3,023%	18/04/2011	18/04/2016	EUR	42.714.000	42.714.000	-	0,122%	-	Government Development Banks	100,000	NL
Nomura Bank International PLC	3,300%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	2.331.328	2.331.328	92,94	0,907%	-	Financial Services	100,000	GB
Nomura Bank International PLC	3,200%	17/10/2011	17/10/2016	EUR	165.248.400	165.248.400	-	1,180%	-	Financial Services	100,000	GB
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	3,400%	17/06/2011	17/06/2016	EUR	142.940.000	142.940.000	-	0,376%	-	Banks	98,420	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,713%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	145.108.000	145.108.000	14,94	0,297%	-	Banks	100,000	DE

Norddeutsche Landesbank Girozentrale	3,500%	05/04/2011	05/04/2016	EUR	284.460.000	284.460.000	-	0,268%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	3,250%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	134.690.000	134.690.000	-	0,347%	-	Banks	99,880	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,500%	12/01/2011	12/01/2016	EUR	26.166.000	26.166.000	43,90	0,417%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,500%	09/02/2011	09/02/2016	EUR	27.417.600	27.417.600	45,53	0,433%	-	Banks	100,500	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	2,750%	18/07/2011	18/07/2016	EUR	7.032.200	7.032.200	57,82	0,556%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,000%	29/09/2011	29/09/2016	EUR	6.793.200	6.793.200	39,26	0,371%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	3,000%	27/01/2011	27/01/2016	EUR	137.020.000	137.020.000	-	0,279%	-	Banks	99,520	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	2,680%	15/08/2011	15/08/2016	EUR	72.170.000	72.170.000	46,91	0,447%	-	Banks	99,950	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,959%	05/09/2011	05/09/2016	EUR	141.152.000	141.152.000	32,47	0,373%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,732%	06/07/2011	06/06/2016	EUR	143.323.000	143.323.000	22,73	0,355%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,911%	04/05/2011	04/05/2016	EUR	296.990.000	296.990.000	13,00	0,178%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,957%	07/06/2011	07/06/2016	EUR	293.582.000	293.582.000	31,04	0,288%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,000%	27/09/2011	27/09/2016	EUR	6.798.200	6.798.200	38,50	0,363%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,059%	17/05/2011	17/05/2016	EUR	28.339.200	28.339.200	35,15	0,399%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	3,875%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	296.520.000	296.520.000	-	0,240%	-	Banks	99,970	DE
Nordea Bank AB	3,625%	11/02/2011	11/02/2016	EUR	1.352.080.000	1.352.080.000	-	0,083%	AA-	Diversified Banks	99,775	SE
Nordea Bank AB	0,761%	27/01/2011	27/01/2016	EUR	27.404.000	27.404.000	33,32	0,311%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank Finland Abp	0,361%	25/05/2011	09/05/2016	EUR	70.525.000	70.525.000	11,11	0,159%	-	Banks	100,000	FI
Nordea Bank Finland Abp	0,366%	27/04/2011	27/04/2016	EUR	73.425.000	73.425.000	11,22	0,160%	-	Banks	100,000	FI
Nordex SE	6,375%	12/04/2011	12/04/2016	EUR	217.267.500	217.267.500	-	1,466%	-	Renewable Energy	99,481	DE
Norske Skogindustrier ASA	11,750%	10/06/2011	15/06/2016	EUR	174.541.250	215.625.000	-	20,669%	CCC-	Forest & Paper Products Manufacturing	95,491	NO
Norske Skogindustrier ASA	11,750%	10/06/2011	15/06/2016	EUR	174.541.250	215.625.000	-	20,486%	CCC-	Forest & Paper Products Manufacturing	95,491	NO
Novo Banco SA	6,875%	15/07/2011	15/07/2016	EUR	115.164.720	115.164.720	-	3,324%	NR	Banks	99,984	PT
NRW Bank	3,250%	19/04/2011	19/04/2016	EUR	143.146.000	143.146.000	-	0,131%	AA-	Government Development Banks	99,880	DE
Nyrstar NV	5,375%	11/05/2011	11/05/2016	EUR	590.187.803	746.508.000	-	3,100%	-	Metals & Mining	101,623	BE
Oberbank AG	3,000%	29/12/2011	29/12/2016	EUR	64.708.000	64.708.000	-	1,181%	-	Banks	100,000	AT
Oberbank AG	2,500%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	67.245.000	67.245.000	-	1,058%	-	Banks	98,000	AT
Oberbank AG	2,700%	10/10/2011	10/10/2016	EUR	68.305.000	68.305.000	-	1,158%	-	Banks	100,000	AT
Oberbank AG	1,011%	24/05/2011	09/05/2016	EUR	35.223.500	35.223.500	110,39	1,152%	-	Banks	100,000	AT

Oberbank AG	3,125%	27/01/2011	27/01/2016	EUR	68.510.000	68.510.000	-	1,015%	-	Banks	99,750	AT
Oberoesterreichische Landesbank AG	0,458%	22/08/2011	22/08/2016	EUR	9.135.999	10.071.180	25,56	0,234%	-	Banks	100,000	AT
Oberoesterreichischen Gesundheits- und Spitals-AG	0,636%	20/12/2011	20/12/2016	EUR	13.087.100	13.087.100	56,04	0,538%	-	Health Care Facilities & Services	100,000	AT
OBI AG	5,000%	28/04/2011	28/04/2016	EUR	147.960.000	147.960.000	-	0,262%	-	Retail - Consumer Discretionary	98,605	DE
Oldenburgische Landesbank AG	3,150%	04/04/2011	04/04/2016	EUR	28.431.000	28.431.000	-	0,480%	-	Banks	100,000	DE
OP Cooperative	1,069%	22/03/2011	22/03/2016	EUR	269.601.716	269.601.716	5,59	0,133%	-	Banks	100,000	FI
Peach Property Group Deutschland AG	6,600%	18/07/2011	30/06/2016	EUR	70.322.000	70.322.000	-	3,408%	-	Homebuilders	100,000	DE
Pirelli & C. SpA	5,125%	22/02/2011	22/02/2016	EUR	682.910.000	682.910.000	-	0,610%	-	Auto Parts Manufacturing	99,626	IT
Pohjola Bank Oyj	3,125%	12/01/2011	12/01/2016	EUR	654.150.000	654.150.000	-	0,084%	AA-	Banks	99,545	FI
Pohjola Bank Oyj	1,185%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	145.104.000	145.104.000	23,43	0,212%	-	Banks	100,000	FI
Procar Automobile Finanz-Holding GmbH & Co KG	7,750%	14/10/2011	14/10/2016	EUR	16.617.000	16.617.000	-	4,600%	-	Automobiles Manufacturing	100,000	DE
Province of Pesaro e Urbino Italy	2,750%	03/01/2011	03/01/2016	EUR	2.149.411	2.149.411	-	2,966%	-	Government Regional	100,000	IT
Rabobank Structured Products	0,000%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	13.805.000	13.805.000	127,16	1,250%	-	Financial Services	100,000	NL
Raiffeisen Bank International AG	3,000%	10/06/2011	10/06/2016	EUR	29.468.750	35.937.500	105,66	1,035%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	3,000%	25/01/2011	25/01/2016	EUR	81.850.800	81.850.800	99,58	0,974%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	0,000%	06/07/2011	06/07/2016	EUR	143.323.000	143.323.000	-	1,089%	-	Banks	83,830	AT
Raiffeisenbank Saalbach-Hinterglemm-Viehhofen	0,380%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	8.707.931	8.707.931	123,36	1,212%	-	Banks	100,650	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	0,986%	05/09/2011	05/09/2016	EUR	69.164.480	69.164.480	111,25	1,090%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	5,000%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	71.100.960	71.100.960	-	1,026%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	3,000%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	71.100.960	71.100.960	115,84	1,136%	-	Banks	100,650	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	3,000%	31/10/2011	31/10/2016	EUR	68.335.890	68.335.890	-	1,008%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	4,000%	09/05/2011	09/05/2016	EUR	70.123.900	70.123.900	-	0,986%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	5,000%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	65.998.100	65.998.100	-	0,993%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	3,500%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	66.703.700	66.703.700	-	0,952%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	3,000%	28/11/2011	28/11/2016	EUR	65.232.230	65.232.230	-	1,016%	-	Banks	100,400	AT
Raiffeisenlandesbank Kaernten GmbH	2,750%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	14.570.800	14.570.800	121,27	1,191%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	3,000%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	67.610.968	72.200.000	200,84	1,986%	-	Banks	100,350	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	3,000%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	47.181.866	52.719.187	190,42	1,882%	-	Banks	101,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	0,000%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	10.251.950	10.251.950	-	2,034%	-	Banks	84,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	3,000%	07/03/2011	07/03/2016	EUR	68.088.464	69.820.000	200,57	1,984%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	0,000%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	1.092.663	1.092.663	-	2,161%	-	Banks	85,000	AT

Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,238%	03/10/2011	03/10/2016	EUR	79.602.600	79.602.600	175,18	1,921%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	3,350%	10/01/2011	10/01/2016	EUR	6.470.500	6.470.500	-	2,078%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	3,000%	16/02/2011	16/02/2016	EUR	18.560.349	135.477.000	130,61	1,284%	-	Banks	100,750	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	2,250%	22/08/2011	22/08/2016	EUR	12.517.038	57.549.600	137,50	1,353%	-	Banks	100,600	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	2,500%	30/08/2011	30/08/2016	EUR	15.718.890	57.684.000	-	1,142%	-	Banks	99,650	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	3,125%	27/07/2011	27/07/2016	EUR	3.590.750	57.452.000	-	1,210%	-	Banks	100,150	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	3,625%	05/04/2011	05/04/2016	EUR	15.929.760	56.892.000	-	1,135%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG	4,250%	13/04/2011	13/04/2016	EUR	70.804.510	70.804.510	-	0,982%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG	2,500%	07/01/2011	07/01/2016	EUR	63.332.010	63.332.010	102,47	1,055%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen-Landesbank Tirol AG	0,731%	19/10/2011	19/10/2016	EUR	27.572.400	27.572.400	115,08	1,129%	-	Banks	100,700	AT
Raiffeisen-Landesbank Tirol AG	0,587%	09/03/2011	09/03/2016	EUR	27.800.000	27.800.000	109,02	1,068%	-	Banks	100,300	AT
Raiffeisen-Landesbank Tirol AG	0,485%	28/09/2011	28/09/2016	EUR	27.224.000	27.224.000	117,15	1,150%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	3,650%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	7.093.850	7.093.850	-	1,055%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	3,900%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	4.390.200	4.390.200	-	3,879%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	4,000%	18/01/2011	18/01/2016	EUR	13.360.100	13.360.100	-	1,020%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenverband Salzburg	4,500%	10/05/2011	10/05/2016	EUR	43.068.000	43.068.000	-	1,033%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenverband Salzburg	2,000%	06/07/2011	06/07/2016	EUR	42.996.900	42.996.900	99,34	1,145%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenverband Salzburg	0,690%	23/12/2011	23/12/2016	EUR	39.168.900	39.168.900	118,17	1,160%	-	Banks	100,650	AT
Raiffeisenverband Salzburg	0,490%	26/09/2011	26/09/2016	EUR	40.382.700	40.382.700	116,08	1,139%	-	Banks	100,650	AT
Raiffeisenverband Salzburg	2,500%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	42.563.100	42.563.100	115,02	1,128%	-	Banks	100,400	AT
Raiffeisenverband Salzburg	2,000%	14/02/2011	14/02/2016	EUR	40.488.000	40.488.000	104,84	1,105%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,500%	23/11/2011	23/11/2016	EUR	40.091.100	40.091.100	122,08	1,199%	-	Banks	100,700	AT
RCI Banque SA	4,000%	16/03/2011	16/03/2016	EUR	1.041.720.000	1.041.720.000	-	0,293%	BBB	Automobiles Manufacturing	99,500	FR
Region of Bruxelles-Capitale Belgium	0,877%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	35.983.750	35.983.750	21,03	0,188%	-	Government Regional	100,000	BE
Region Wallonne Belgium	0,888%	02/06/2011	02/06/2016	EUR	31.828.720	31.828.720	26,98	0,248%	-	Government Regional	100,000	BE
Renault SA	4,625%	25/05/2011	25/05/2016	EUR	1.057.875.000	1.057.875.000	-	0,483%	BBB-	Automobiles Manufacturing	99,459	FR
Royal Bank of Scotland NV	0,988%	23/08/2011	23/08/2016	EUR	7.211.650	7.211.650	37,52	0,353%	-	Banks	100,000	NL
Royal Bank of Scotland NV	1,692%	08/08/2011	08/08/2016	EUR	35.541.500	35.541.500	33,63	0,314%	-	Banks	100,000	NL
Royal Bank of Scotland PLC/The	4,750%	18/05/2011	18/05/2016	EUR	607.478.941	1.425.950.000	-	0,284%	BBB+	Banks	99,704	GB

Royal Bank of Scotland PLC/The	4,000%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	2.795.400.000	2.795.400.000	-	0,008%	-	Banks	99,459	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,375%	23/11/2011	23/11/2016	EUR	1.002.277.500	1.002.277.500	-	0,020%	-	Banks	99,837	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,800%	23/05/2011	23/05/2016	EUR	15.866.330	15.866.330	89,15	0,870%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,700%	05/05/2011	05/05/2016	EUR	4.372.740	4.372.740	93,23	0,910%	BBB+	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,500%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	2.902.080	2.902.080	80,17	0,949%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	4,120%	16/03/2011	16/03/2016	EUR	9.028.240	9.028.240	-	0,873%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	0,981%	27/04/2011	27/04/2016	EUR	1.909.050	7.342.500	88,26	0,861%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,000%	14/01/2011	14/01/2016	EUR	33.370.000	33.370.000	77,70	0,755%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	4,000%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	1.956.780	1.956.780	-	0,936%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,350%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	14.382.000	14.382.000	-	0,676%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	0,761%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	1.420.030	1.420.030	89,72	0,875%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,650%	09/03/2011	09/03/2016	EUR	6.950.000	6.950.000	89,46	0,873%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,250%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	56.760.000	56.760.000	79,98	0,778%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	5,000%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	4.257.000	4.257.000	-	0,937%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,500%	31/08/2011	31/08/2016	EUR	14.410.000	14.410.000	92,85	0,906%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,250%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	14.510.400	14.510.400	89,44	0,872%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,250%	29/03/2011	29/03/2016	EUR	14.081.000	14.081.000	85,84	0,836%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	4,250%	07/12/2011	07/12/2016	EUR	20.136.000	20.136.000	98,59	0,964%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,800%	01/12/2011	01/12/2016	EUR	1.344.350	1.344.350	109,68	1,075%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,500%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	6.724.500	6.724.500	97,39	0,952%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,250%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	14.382.000	14.382.000	89,69	0,875%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,500%	12/07/2011	12/07/2016	EUR	4.202.700	4.202.700	95,74	0,935%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,350%	19/07/2011	19/07/2016	EUR	1.416.060	1.416.060	100,21	0,980%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,500%	31/10/2011	31/10/2016	EUR	20.919.150	20.919.150	94,30	0,921%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,600%	19/05/2011	19/05/2016	EUR	4.291.560	4.291.560	93,91	0,917%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,250%	05/05/2011	05/05/2016	EUR	14.575.800	14.575.800	86,90	0,847%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,250%	06/04/2011	06/04/2016	EUR	2.864.600	2.864.600	92,65	0,905%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,250%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	14.190.000	14.190.000	85,86	0,837%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	4,000%	04/02/2011	04/02/2016	EUR	8.826.870	8.826.870	80,32	0,854%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,250%	25/02/2011	25/02/2016	EUR	68.801.000	68.801.000	77,96	0,758%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,000%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	1.379.210	1.379.210	85,19	0,916%	-	Banks	100,000	GB

Royal Bank of Scotland PLC/The	3,450%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	2.048.760	2.048.760	95,53	0,933%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	3,040%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	40.947.600	40.947.600	71,11	0,761%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	0,991%	11/08/2011	11/08/2016	EUR	1.705.680	1.705.680	90,84	0,886%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	5,000%	14/01/2011	14/01/2016	EUR	6.674.000	6.674.000	-	0,881%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	6,000%	25/02/2011	25/02/2016	EUR	13.760.200	13.760.200	-	0,901%	-	Banks	100,000	GB
Royalbeach Spielwaren Und Sportartikel Vertriebs GmbH	8,125%	28/10/2011	28/10/2016	EUR	35.405.000	35.405.000	-	11,713%	-	Distributors - Consumer Discr.	100,000	DE
Sampo Oyj	4,250%	22/02/2011	22/02/2016	EUR	409.746.000	409.746.000	-	0,241%	-	Property & Casualty Insurance	99,445	FI
Santander International Products PLC	3,000%	12/09/2011	12/09/2016	EUR	2.721.400	2.721.400	100,75	0,986%	-	Banks	100,000	IE
SEB SA	4,500%	03/06/2011	03/06/2016	EUR	438.900.000	438.900.000	-	0,648%	-	Home Improvement	99,798	FR
Semper Idem Underberg GmbH	7,125%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	101.469.900	101.469.900	-	1,997%	-	Food & Beverage	100,000	DE
SeniVita Sozial gemeinnuetzige GmbH	6,500%	17/05/2011	17/05/2016	EUR	21.254.400	21.254.400	-	3,729%	-	Health Care Facilities & Services	100,000	DE
Skandinaviska Enskilda Banken AB	3,750%	19/05/2011	19/05/2016	EUR	1.072.890.000	1.072.890.000	-	0,133%	A+	Banks	99,870	SE
SNS Bank NV	6,625%	30/11/2011	30/11/2016	EUR	405.127.401	405.127.401	-	0,356%	BBB	Banks	99,855	NL
Societe Fonciere Lyonnaise SA	4,625%	25/05/2011	25/05/2016	EUR	423.150.000	705.250.000	-	0,353%	BBB	Real Estate	99,603	FR
Societe Generale Effekten GmbH	3,200%	07/04/2011	07/04/2016	EUR	71.495.000	71.495.000	315,11	3,129%	-	Banks	101,500	DE
Societe Generale Effekten GmbH	2,800%	07/04/2011	07/04/2016	EUR	71.495.000	71.495.000	36,74	0,345%	-	Banks	101,500	DE
Societe Generale Effekten GmbH	1,036%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	21.186.000	21.186.000	35,81	0,336%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	2,750%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	68.955.000	68.955.000	36,46	0,343%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	3,300%	09/05/2011	09/05/2016	EUR	28.622	28.622	62,38	0,602%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	3,000%	11/03/2011	11/03/2016	EUR	69.390	69.390	60,96	0,588%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	2,500%	24/02/2011	24/02/2016	EUR	68.955.000	68.955.000	35,82	0,336%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale SA	4,000%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	1.811.962.500	1.811.962.500	-	0,133%	A	Diversified Banks	99,862	FR
Societe Generale SA	2,760%	13/05/2011	13/05/2016	EUR	239.985.600	239.985.600	56,17	0,706%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Generale SA	3,000%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	107.531.820	107.531.820	35,56	0,404%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Publique de Gestion de l'Eau SA	3,790%	31/10/2011	31/10/2016	EUR	4.183.830	4.183.830	-	0,658%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	BE
SpareBank 1 Boligkreditt AS	2,375%	22/11/2011	22/11/2016	EUR	1.690.212.500	1.690.212.500	-	0,006%	-	Banks	99,544	NO
SpareBank 1 Nord Norge	1,008%	31/05/2011	25/05/2016	EUR	21.550.500	21.550.500	39,53	0,373%	-	Banks	100,000	NO
SpareBank 1 SMN	1,041%	18/05/2011	18/05/2016	EUR	28.519.000	28.519.000	45,33	0,431%	-	Banks	100,000	NO
SpareBank 1 SR-Bank ASA	0,995%	04/05/2011	04/05/2016	EUR	22.274.250	22.274.250	36,49	0,343%	-	Banks	100,000	NO
Sparkasse Arnstadt-Ilmenau	3,000%	01/05/2011	01/05/2016	EUR	2.974.800	2.974.800	-	0,633%	-	Banks	100,350	DE

Sparkasse Bielefeld	2,125%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	6.933.250	6.933.250	-	0,492%	-	Banks	100,700	DE
Sparkasse Bielefeld	3,000%	09/02/2011	09/02/2016	EUR	13.708.800	13.708.800	-	0,445%	-	Banks	100,850	DE
Sparkasse Bodensee	3,250%	18/07/2011	18/07/2016	EUR	7.032.200	7.032.200	-	0,522%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Bremerhaven	2,250%	15/12/2011	15/12/2016	EUR	6.503.750	6.503.750	-	0,575%	-	Banks	99,700	DE
Sparkasse Essen	3,000%	04/03/2011	04/03/2016	EUR	13.977.000	13.977.000	-	0,568%	-	Banks	100,600	DE
Sparkasse Freising	3,000%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	16.221.480	16.221.480	-	0,537%	-	Banks	100,550	DE
Sparkasse Goettingen	3,000%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	6.824.600	6.824.600	-	0,562%	-	Banks	98,620	DE
Sparkasse Goettingen	2,100%	14/11/2011	14/11/2016	EUR	6.810.350	6.810.350	-	0,598%	-	Banks	99,000	DE
Sparkasse Hannover	3,000%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	7.100.150	7.100.150	-	0,625%	-	Banks	100,130	DE
Sparkasse Jena-Saale-Holzland	3,250%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	7.196.750	7.196.750	-	0,607%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Koblenz	2,250%	11/01/2011	11/01/2016	EUR	6.484.700	6.484.700	-	0,694%	-	Banks	97,700	DE
Sparkasse KoelnBonn	2,750%	05/01/2011	05/01/2016	EUR	26.366.000	26.366.000	-	0,498%	-	Banks	99,700	DE
Sparkasse KoelnBonn	2,375%	28/10/2011	28/10/2016	EUR	28.324.000	28.324.000	-	0,533%	-	Banks	99,600	DE
Sparkasse Kufstein - Tiroler Sparkasse von 1877	0,364%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	7.146.650	7.146.650	139,10	1,439%	-	Banks	100,500	AT
Sparkasse Kufstein - Tiroler Sparkasse von 1877	2,750%	22/08/2011	22/08/2016	EUR	7.193.700	7.193.700	-	1,291%	-	Banks	100,350	AT
Sparkasse Kufstein - Tiroler Sparkasse von 1877	3,500%	08/04/2011	08/04/2016	EUR	7.210.750	7.210.750	-	1,276%	-	Banks	100,100	AT
Sparkasse Kulmbach-Kronach	2,500%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	11.608.640	11.608.640	-	0,601%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Mittelfranken-Sued	2,500%	13/01/2011	13/01/2016	EUR	6.677.500	6.677.500	-	0,707%	-	Banks	101,300	DE
Sparkasse Mittelfranken-Sued	0,000%	22/12/2011	22/12/2016	EUR	13.049.200	13.049.200	68,70	0,665%	-	Banks	100,500	DE
Sparkasse Mittelsachsen	1,270%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	1.361.340	1.361.340	76,30	0,741%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Osnabrueck	2,750%	17/08/2011	17/08/2016	EUR	7.219.600	7.219.600	-	0,513%	-	Banks	99,770	DE
Sparkasse Osnabrueck	3,000%	04/04/2011	15/04/2016	EUR	7.107.750	7.107.750	-	0,495%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Paderborn-Detmold/Detmold	2,850%	09/02/2011	09/02/2016	EUR	6.854.400	6.854.400	-	0,582%	-	Banks	100,200	DE
Sparkasse Pforzheim Calw	3,125%	03/05/2011	03/05/2016	EUR	14.850.600	14.850.600	-	0,339%	-	Banks	99,550	DE
Sparkasse Rhein-Nahe	3,270%	30/06/2011	30/06/2016	EUR	7.255.200	7.255.200	-	0,518%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Rosenheim-Bad Aibling	2,300%	26/01/2011	26/01/2016	EUR	6.841.600	6.841.600	-	0,449%	-	Banks	100,950	DE
Sparkasse Rosenheim-Bad Aibling	2,750%	22/06/2011	22/06/2016	EUR	28.829.400	28.829.400	-	0,424%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Schaumburg	2,750%	07/03/2011	04/03/2016	EUR	6.982.000	6.982.000	-	0,620%	-	Banks	100,230	DE
Sparkasse Schwaebisch Hall-Craillsheim	1,427%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	6.806.700	6.806.700	66,28	0,641%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Schwaebisch Hall-Craillsheim	1,427%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	2.722.680	2.722.680	70,24	0,680%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Schwaebisch Hall-Craillsheim	1,630%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	2.042.010	2.042.010	71,87	0,697%	-	Banks	100,000	DE

Sparkasse Schwaebisch Hall-Craillsheim	1,270%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	2.722.680	2.722.680	69,92	0,677%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Schwaz AG	3,000%	25/05/2011	25/05/2016	EUR	8.463.000	11.284.000	-	1,194%	-	Banks	100,000	AT
Sparkasse Ulm	2,800%	18/04/2011	18/04/2016	EUR	7.119.000	7.119.000	-	0,556%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse UnnaKame	2,250%	27/01/2011	27/01/2016	EUR	6.851.000	6.851.000	-	0,721%	-	Banks	100,330	DE
Sparkasse Werra-Meissner	2,250%	19/12/2011	19/12/2016	EUR	19.521.450	19.521.450	-	0,629%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse zu Luebeck AG	2,830%	01/02/2011	01/02/2016	EUR	6.911.500	6.911.500	-	0,653%	-	Banks	100,000	DE
Stadt- und Kreis-Sparkasse Darmstadt	2,750%	14/06/2011	14/06/2016	EUR	7.235.850	7.235.850	-	0,583%	-	Banks	100,000	DE
Stadtsparkasse Augsburg	1,270%	10/11/2011	10/11/2016	EUR	5.445.360	5.445.360	70,31	0,681%	-	Banks	100,000	DE
Stadtsparkasse Emmerich-Rees	3,000%	01/05/2011	01/05/2016	EUR	7.437.000	7.437.000	-	0,473%	-	Banks	101,000	DE
Stadtsparkasse Moenchengladbach	2,750%	02/01/2011	02/01/2016	EUR	6.687.650	6.687.650	-	0,571%	-	Banks	100,700	DE
Stadtsparkasse Moenchengladbach	2,650%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	6.902.500	6.902.500	-	0,596%	-	Banks	100,000	DE
Stadtsparkasse Moenchengladbach	3,000%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	7.196.750	7.196.750	-	0,620%	-	Banks	100,900	DE
Stadtsparkasse Moenchengladbach	2,250%	01/12/2011	01/12/2016	EUR	6.721.750	6.721.750	-	0,653%	-	Banks	100,250	DE
Stadtsparkasse Muenchen	2,800%	01/07/2011	01/07/2016	EUR	7.255.400	7.255.400	-	0,626%	-	Banks	101,400	DE
Stadtsparkasse Muenchen	2,000%	21/01/2011	21/01/2016	EUR	6.791.500	6.791.500	-	0,576%	-	Banks	97,820	DE
Stadtsparkasse Muenchen	2,000%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	7.191.000	7.191.000	-	0,609%	-	Banks	99,250	DE
Stadtsparkasse Wuppertal	3,070%	11/04/2011	11/04/2016	EUR	7.220.000	7.220.000	-	0,526%	-	Banks	100,000	DE
Standard Chartered PLC	3,875%	20/10/2011	20/10/2016	EUR	1.713.475.000	1.713.475.000	-	0,253%	A-	Diversified Banks	99,621	GB
State of Brandenburg	2,750%	08/02/2011	08/02/2016	EUR	34.162.500	34.162.500	-	0,082%	-	Government Regional	99,550	DE
State of Hesse	0,111%	28/07/2011	28/07/2016	EUR	114.465.600	114.465.600	6,53	0,043%	AA	Government Regional	99,903	DE
Studio 100 NV	5,500%	06/05/2011	06/05/2016	EUR	57.606.000	57.606.000	-	1,774%	-	Entertainment Content	100,000	BE
Svenska Handelsbanken AB	3,625%	16/02/2011	16/02/2016	EUR	1.354.770.000	1.354.770.000	-	0,074%	AA-	Banks	99,820	SE
Telecom Italia SpA	5,125%	25/01/2011	25/01/2016	EUR	904.928.803	1.364.180.000	-	0,594%	BB+	Wireless Telecommunications S.	99,686	IT
UBM Development AG	6,000%	09/11/2011	09/11/2016	EUR	70.562.205	136.055.000	-	2,882%	-	Real Estate	100,879	AT
UBS AG/Jersey	2,250%	08/07/2011	08/07/2016	EUR	17.186.915	23.177.375	45,51	0,433%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,250%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	4.006.970	4.006.970	49,28	0,471%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	1,850%	26/01/2011	26/01/2016	EUR	11.288.640	11.288.640	40,96	0,388%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,000%	08/04/2011	08/04/2016	EUR	16.728.940	21.776.465	42,22	0,400%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,600%	21/09/2011	21/09/2016	EUR	4.122.240	10.580.416	53,98	0,518%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,500%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	12.080.880	16.539.300	46,66	0,445%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,250%	29/07/2011	29/07/2016	EUR	6.903.360	11.505.600	48,44	0,462%	-	Banks	100,000	JE

UBS AG/Jersey	2,125%	05/10/2011	05/10/2016	EUR	5.657.090	5.657.090	51,96	0,498%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	0,000%	20/10/2011	20/10/2016	EUR	2.741.560	2.741.560	69,67	0,675%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,900%	12/09/2011	12/09/2016	EUR	6.803.500	6.803.500	53,17	0,510%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,250%	04/02/2011	04/02/2016	EUR	10.116.951	14.598.285	41,91	0,397%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,250%	13/09/2011	13/09/2016	EUR	4.112.940	4.112.940	54,07	0,519%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,500%	28/10/2011	28/10/2016	EUR	8.922.060	12.604.180	52,01	0,498%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	1,850%	05/01/2011	05/01/2016	EUR	9.096.270	14.105.810	40,84	0,386%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,250%	25/02/2011	25/02/2016	EUR	13.897.802	26.144.380	41,88	0,397%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,600%	24/10/2011	24/10/2016	EUR	7.656.715	7.656.715	53,56	0,514%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,500%	23/11/2011	23/11/2016	EUR	9.703.383	9.703.383	53,65	0,515%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,125%	02/09/2011	02/09/2016	EUR	11.362.400	11.362.400	47,77	0,456%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,250%	04/08/2011	04/08/2016	EUR	4.249.140	4.249.140	50,50	0,483%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,250%	19/08/2011	19/08/2016	EUR	12.239.915	14.399.900	47,01	0,448%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,200%	13/05/2011	13/05/2016	EUR	5.646.720	5.646.720	48,50	0,463%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,125%	18/03/2011	18/03/2016	EUR	9.348.966	14.023.449	45,47	0,433%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,300%	10/03/2011	10/03/2016	EUR	5.182.500	5.182.500	48,35	0,461%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,400%	17/02/2011	17/02/2016	EUR	1.318.637	1.318.637	48,05	0,458%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,000%	28/01/2011	28/01/2016	EUR	2.566.051	2.566.051	40,28	0,449%	-	Banks	100,500	JE
UBS AG/London	3,000%	06/06/2011	06/06/2016	EUR	1.460.300.000	1.460.300.000	-	0,019%	-	Banks	99,470	GB
UBS AG/London	1,458%	29/11/2011	22/11/2016	EUR	114.637.140	114.637.140	54,45	0,523%	-	Banks	100,000	GB
Unicaja Banco SA	5,500%	23/03/2011	23/03/2016	EUR	706.200.000	706.200.000	-	0,176%	-	Banks	99,927	ES
UniCredit Bank AG	3,000%	12/04/2011	12/04/2016	EUR	8.835.545	8.835.545	49,33	0,471%	BBB	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	2,200%	20/01/2011	20/01/2016	EUR	134.690.000	134.690.000	33,61	0,314%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,581%	09/08/2011	20/07/2016	EUR	71.130.000	71.130.000	284,03	2,818%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	4,000%	04/10/2011	20/10/2016	EUR	27.875.400	27.875.400	-	0,854%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	3,750%	04/04/2011	04/04/2016	EUR	41.793.570	56.862.000	-	0,440%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,750%	19/04/2011	19/04/2016	EUR	28.629.200	28.629.200	43,54	0,413%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,831%	28/01/2011	20/01/2016	EUR	34.032.500	34.032.500	121,40	1,192%	-	Banks	101,250	DE
UniCredit Bank AG	2,800%	15/11/2011	15/11/2016	EUR	13.542.900	13.542.900	-	0,520%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,800%	27/09/2011	27/09/2016	EUR	11.013.084	14.956.040	-	0,510%	BBB	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	1,731%	31/03/2011	20/04/2016	EUR	7.095.000	7.095.000	96,21	0,940%	-	Banks	101,000	DE

UniCredit Bank AG	3,000%	17/05/2011	17/05/2016	EUR	23.379.840	27.630.720	45,76	0,436%	BBB	Banks	101,250	DE
UniCredit Bank AG	2,500%	06/12/2011	06/12/2016	EUR	6.698.350	6.698.350	53,79	0,516%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,200%	05/10/2011	05/10/2016	EUR	9.317.560	9.317.560	49,72	0,475%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,500%	23/08/2011	23/08/2016	EUR	17.307.960	17.307.960	47,04	0,448%	BBB	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	2,250%	18/01/2011	18/01/2016	EUR	10.688.080	10.688.080	44,38	0,422%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	4,100%	04/07/2011	20/07/2016	EUR	4.358.820	4.358.820	125,81	1,236%	-	Banks	102,000	DE
UniCredit Bank AG	1,731%	20/04/2011	20/04/2016	EUR	144.957	144.957	106,90	1,047%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,000%	30/08/2011	30/08/2016	EUR	43.263.000	43.263.000	42,01	0,398%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,800%	18/04/2011	18/04/2016	EUR	28.048.860	35.595.000	43,75	0,415%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,000%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	15.299.340	18.942.040	46,93	0,447%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,500%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	80.120.804	122.842.800	-	0,394%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,750%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	35.920.890	39.554.910	42,53	0,403%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,159%	28/03/2011	29/03/2016	EUR	28.194.000	28.194.000	18,22	0,230%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,000%	04/01/2011	04/01/2016	EUR	42.405.090	66.570.000	-	0,383%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,252%	09/08/2011	09/08/2016	EUR	28.452.000	28.452.000	18,16	0,230%	AAA	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,250%	04/01/2011	04/01/2016	EUR	57.782.760	66.570.000	36,01	0,338%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,500%	01/03/2011	01/03/2016	EUR	25.677.300	41.415.000	-	0,447%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,400%	30/08/2011	30/08/2016	EUR	14.709.420	14.709.420	-	0,507%	BBB	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	3,150%	25/01/2011	25/01/2016	EUR	27.283.600	27.283.600	-	0,430%	BBB	Banks	99,090	DE
UniCredit Bank AG	3,550%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	39.881.940	44.478.000	-	0,441%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,359%	02/12/2011	02/12/2016	EUR	20.089.200	20.089.200	19,63	0,244%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,250%	27/09/2011	27/09/2016	EUR	2.719.280	2.719.280	55,10	0,529%	BBB	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	3,000%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	11.297.160	13.449.000	-	0,516%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,800%	30/09/2011	30/09/2016	EUR	13.449.000	13.449.000	-	0,502%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,000%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	12.211.950	12.211.950	48,87	0,467%	BBB	Banks	101,250	DE
UniCredit Bank AG	2,800%	06/04/2011	06/04/2016	EUR	9.882.870	21.484.500	48,27	0,461%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,750%	24/05/2011	24/05/2016	EUR	28.178.800	28.178.800	44,39	0,422%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,900%	14/06/2011	14/06/2016	EUR	13.024.530	13.024.530	48,65	0,464%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	3,000%	07/06/2011	07/06/2016	EUR	4.550.521	4.550.521	53,40	0,512%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,841%	10/02/2011	10/02/2016	EUR	27.252.000	27.252.000	36,21	0,340%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,500%	27/01/2011	27/01/2016	EUR	17.127.500	20.553.000	-	0,459%	BBB	Banks	100,000	DE

UniCredit Bank AG	2,500%	14/03/2011	14/03/2016	EUR	33.994.971	41.969.100	41,93	0,397%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,000%	26/10/2011	26/10/2016	EUR	13.830.400	13.830.400	-	0,518%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,200%	22/07/2011	22/07/2016	EUR	17.238.000	143.650.000	-	0,482%	BBB	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank Austria AG	2,875%	04/11/2011	04/11/2016	EUR	689.710.000	689.710.000	-	0,070%	-	Banks	99,647	AT
UniCredit Bank Austria AG	2,400%	11/01/2011	11/01/2016	EUR	165.593.299	194.541.000	113,66	1,115%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	5,000%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	90.881.920	142.003.000	-	1,279%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	2,500%	12/04/2011	12/04/2016	EUR	76.912.695	144.845.000	122,67	1,205%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	2,750%	28/02/2011	28/02/2016	EUR	68.298.479	68.298.479	122,58	1,204%	BBB	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	3,500%	01/12/2011	01/12/2016	EUR	22.181.775	67.217.500	134,87	1,327%	-	Banks	101,500	AT
UniCredit Bank Austria AG	0,482%	14/01/2011	14/01/2016	EUR	133.480.000	133.480.000	11,98	0,098%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	3,000%	21/09/2011	21/09/2016	EUR	13.740.800	68.704.000	133,09	1,309%	-	Banks	101,500	AT
UniCredit Bank Austria AG	0,436%	16/06/2011	16/06/2016	EUR	35.407.500	35.407.500	32,63	0,304%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	3,250%	03/06/2011	03/06/2016	EUR	46.816.000	73.150.000	128,32	1,261%	-	Banks	101,500	AT
UniCredit Bank Austria AG	0,521%	16/11/2011	16/11/2016	EUR	13.522.300	13.522.300	9,07	0,069%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	2,900%	11/08/2011	11/08/2016	EUR	4.264.200	4.264.200	136,32	1,341%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit SpA	3,105%	31/03/2011	31/03/2016	EUR	1.009.866.825	1.009.866.825	87,05	0,848%	-	Banks	100,000	IT
UniCredit SpA	1,487%	31/05/2011	31/05/2016	EUR	11.493.600	11.493.600	130,29	1,281%	-	Banks	100,000	IT
UniCredit SpA	4,323%	21/02/2011	21/02/2016	EUR	4.103.010	4.103.010	-	1,367%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	4,500%	22/02/2011	22/02/2016	EUR	1.024.365.000	1.024.365.000	-	0,068%	-	Banks	99,636	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	0,822%	30/05/2011	30/05/2016	EUR	621.049.500	621.049.500	89,55	0,943%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	4,750%	03/10/2011	03/10/2016	EUR	3.170.837	33.167.750	-	1,721%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	3,750%	14/06/2011	14/06/2016	EUR	188.132	188.132	-	1,134%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	4,000%	15/09/2011	15/09/2016	EUR	152.532	34.666.250	-	1,633%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	3,750%	26/04/2011	26/04/2016	EUR	1.785.348	36.585.000	-	0,994%	-	Banks	100,000	IT
Uponor OYJ	1,799%	21/06/2011	21/06/2016	EUR	28.795.200	28.795.200	106,27	1,111%	-	Electrical Equipment Manuf.	100,000	FI
Valensina GmbH	7,375%	28/04/2011	28/04/2016	EUR	96.174.000	125.766.000	-	4,224%	-	Food & Beverage	100,000	DE
Veneto Banca SpA	4,250%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	8.450.820	14.826.000	-	2,197%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	4,300%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	36.457.850	36.457.850	-	2,210%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	0,550%	17/01/2011	17/01/2016	EUR	825.620	825.620	329,65	3,345%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	0,300%	17/01/2011	17/01/2016	EUR	2.978.080	2.978.080	332,69	3,376%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	0,000%	18/11/2011	18/11/2016	EUR	15.820.840	25.948.231	-	3,000%	-	Banks	75,554	IT

Veneto Banca SpA	0,559%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	7.574.440	7.574.440	229,90	2,347%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	0,000%	18/11/2011	18/11/2016	EUR	4.054.200	4.054.200	-	2,787%	-	Banks	75,554	IT
Veneto Banca SpA	3,600%	18/07/2011	18/07/2016	EUR	1.044.985	1.044.985	-	2,550%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	4,250%	22/07/2011	22/07/2016	EUR	7.132.223	7.182.500	-	2,554%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	0,567%	29/04/2011	29/04/2016	EUR	6.483.410	6.483.410	224,42	2,292%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	4,200%	22/07/2011	22/07/2016	EUR	6.057.721	28.730.000	-	2,504%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	0,559%	16/05/2011	16/05/2016	EUR	1.564.873	1.564.873	229,90	2,347%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	0,554%	25/05/2011	25/05/2016	EUR	7.189.319	7.189.319	223,70	2,285%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	5,000%	04/07/2011	04/07/2016	EUR	58.117.600	58.117.600	-	2,382%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	4,000%	15/02/2011	15/02/2016	EUR	6.758.950	6.758.950	-	1,877%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	5,000%	03/10/2011	03/10/2016	EUR	3.316.775	3.316.775	-	2,714%	-	Banks	100,000	IT
Volksbank Darmstadt-Suedhessen eG	3,000%	01/08/2011	01/08/2016	EUR	7.119.350	7.119.350	-	0,502%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Euskirchen	3,250%	30/01/2011	30/01/2016	EUR	6.848.500	6.848.500	-	0,541%	-	Banks	102,280	DE
Volksbank Raiffeisenbank Bayern Mitte eG	4,000%	19/04/2011	19/04/2016	EUR	7.157.300	7.157.300	-	0,748%	-	Banks	99,900	DE
Volksbank Raiffeisenbank Bayern Mitte eG	2,750%	01/09/2011	01/09/2016	EUR	7.146.650	7.146.650	-	0,729%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Schwaebisch Gmuend eG	4,000%	15/03/2011	15/03/2016	EUR	2.795.400	2.795.400	-	0,609%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Vorarlberg eG	2,250%	18/02/2011	18/02/2016	EUR	6.835.000	6.835.000	132,98	1,308%	-	Banks	100,000	AT
Volkswagen Leasing GmbH	3,375%	03/06/2011	03/06/2016	EUR	1.097.250.000	1.097.250.000	-	0,145%	A	Automobiles Manufacturing	99,819	DE
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	2,125%	21/11/2011	21/11/2016	EUR	13.506.700	13.506.700	-	0,403%	-	Banks	100,000	AT
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	2,500%	21/04/2011	21/04/2016	EUR	13.842.260	17.485.689	163,41	1,612%	-	Banks	100,000	AT
VR-Bank Landau eG	2,435%	23/08/2011	23/08/2016	EUR	7.211.650	7.211.650	-	0,554%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	2,125%	07/11/2011	07/11/2016	EUR	68.734.500	68.734.500	-	0,460%	-	Banks	100,100	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	2,125%	11/02/2011	11/02/2016	EUR	67.604.000	67.604.000	44,93	0,427%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	3,250%	03/02/2011	03/02/2016	EUR	68.246.000	68.246.000	-	0,467%	-	Banks	101,220	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	2,500%	28/12/2011	28/12/2016	EUR	12.937.900	12.937.900	-	0,544%	-	Banks	100,610	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	3,125%	06/05/2011	06/05/2016	EUR	36.003.750	36.003.750	-	0,238%	NR	Consumer Finance	99,890	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,374%	01/06/2011	01/06/2016	EUR	28.787.000	28.787.000	66,04	0,708%	AA-	Consumer Finance	99,880	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,388%	22/08/2011	22/08/2016	EUR	28.774.800	28.774.800	74,59	0,724%	AA-	Consumer Finance	99,952	DE

WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	3,300%	04/04/2011	30/03/2016	EUR	28.431.000	28.431.000	-	0,775%	AA-	Consumer Finance	99,950	DE
Wuestenrot Bank AG Pfandbriefbank	0,169%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	156.064.700	156.064.700	0,72	0,055%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
Wuestenrot Bank AG Pfandbriefbank	0,196%	24/03/2011	24/03/2016	EUR	14.187.700	14.187.700	21,49	0,193%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
Wuestenrot Bank AG Pfandbriefbank	3,000%	02/03/2011	01/04/2016	EUR	13.864.500	13.864.500	-	0,216%	AAA	Consumer Finance	100,250	DE
YIT OYJ	5,567%	20/06/2011	20/06/2016	EUR	143.040.000	143.040.000	-	1,584%	-	Homebuilders	99,843	FI

Emisión de Bonos en Europa en el año 2012– Fuente Bloomberg

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
Aareal Bank AG	0,142%	23/05/2012	23/05/2017	EUR	31.401.000	31.401.000	3,21	0,201%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,987%	29/11/2012	29/11/2017	EUR	12.972.100	12.972.100	54,41	0,522%	-	Financial Services	99,900	DE
Aareal Bank AG	1,228%	14/08/2012	14/08/2017	EUR	12.333.800	12.333.800	43,23	0,480%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	2,125%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	79.831.700	79.831.700	-	0,474%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,069%	14/12/2012	14/12/2017	EUR	65.840.500	65.840.500	13,26	0,181%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	1,810%	22/11/2012	22/11/2017	EUR	64.294.500	64.294.500	-	0,527%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,096%	20/11/2012	20/11/2017	EUR	25.612.000	25.612.000	16,97	0,218%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,401%	19/04/2012	19/04/2017	EUR	78.742.800	78.742.800	4,22	0,020%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	2,050%	01/10/2012	02/10/2017	EUR	32.242.250	32.242.250	-	0,539%	-	Financial Services	100,070	DE
Aareal Bank AG	1,750%	27/04/2012	27/04/2017	EUR	13.256.100	13.256.100	-	0,201%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,728%	22/05/2012	22/05/2017	EUR	19.103.700	19.103.700	27,11	0,249%	-	Financial Services	99,800	DE
Aareal Bank AG	2,125%	18/04/2012	18/04/2017	EUR	26.231.200	26.231.200	-	0,182%	-	Financial Services	99,930	DE
Aareal Bank AG	1,700%	10/10/2012	10/10/2017	EUR	12.889.300	12.889.300	-	0,573%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,369%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	26.525.400	26.525.400	17,23	0,220%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	1,625%	18/05/2012	18/05/2017	EUR	127.310.000	127.310.000	-	0,060%	-	Financial Services	100,000	DE
Abanca Corporacion Bancaria SA	3,945%	30/04/2012	30/04/2017	EUR	1.844.136.540	1.844.136.540	89,63	0,874%	-	Banks	100,000	ES
ABN AMRO Bank NV	0,685%	27/09/2012	27/09/2017	EUR	19.344.000	19.344.000	54,14	0,519%	-	Banks	100,000	NL
ABN AMRO Bank NV	1,102%	22/05/2012	22/05/2017	EUR	12.735.800	12.735.800	32,77	0,497%	-	Banks	100,000	NL
Accor SA	2,875%	19/06/2012	19/06/2017	EUR	888.426.000	888.426.000	-	0,452%	BBB-	Travel & Lodging	99,505	FR
Aegon NV	3,000%	18/07/2012	18/07/2017	EUR	613.280.000	613.280.000	-	0,347%	A-	Life Insurance	99,712	NL
AIB Mortgage Bank	0,279%	13/12/2012	13/12/2017	EUR	522.780.000	522.780.000	34,54	0,271%	AA	Consumer Finance	100,000	IE
Air France-KLM	6,250%	14/12/2012	18/01/2018	EUR	658.405.000	658.405.000	-	2,858%	-	Airlines	99,451	FR
Allgemeine Sparkasse Oberoesterreich Bank AG	2,500%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	39.387.900	39.387.900	-	1,066%	-	Banks	100,000	AT
Alstom SA	2,250%	11/10/2012	11/10/2017	EUR	452.921.000	452.921.000	-	0,676%	BBB-	Electrical Equipment Manufacturing	99,440	FR
Art Investment Consulting GmbH	6,000%	11/04/2012	30/04/2017	EUR	13.118.500	13.118.500	-	4,416%	-	Consumer Services	101,500	AT
Asset Banca SpA	5,000%	10/12/2012	10/12/2017	EUR	6.468.600	6.468.600	-	1,186%	-	Banks	100,000	SM

Atenor Group	5,375%	26/10/2012	26/10/2017	EUR	77.580.000	77.580.000	-	2,306%	-	Homebuilders	101,875	BE
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,850%	10/10/2012	10/10/2017	EUR	6.444.650	6.444.650	-	1,566%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,050%	14/05/2012	14/05/2017	EUR	19.269.000	19.269.000	131,43	1,362%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,500%	18/12/2012	18/12/2017	EUR	13.229.900	13.229.900	-	1,575%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,850%	10/09/2012	10/09/2017	EUR	6.391.700	6.391.700	-	1,543%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,750%	23/11/2012	23/11/2017	EUR	9.739.575	9.739.575	-	1,578%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	4,500%	14/05/2012	14/05/2017	EUR	19.269.000	19.269.000	-	1,438%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,500%	05/12/2012	05/12/2017	EUR	9.814.425	9.814.425	-	1,579%	-	Banks	100,000	IT
Banca Apulia SpA	3,000%	02/04/2012	02/04/2017	EUR	21.725.455	21.725.455	334,67	3,395%	-	Banks	100,000	IT
Banca Apulia SpA	2,000%	17/09/2012	17/09/2017	EUR	13.117.600	13.117.600	355,95	3,607%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carige SpA	6,750%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	793.848.000	793.848.000	-	0,739%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carige SpA	4,000%	20/11/2012	20/11/2017	EUR	128.060.000	128.060.000	-	1,476%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carime SpA	2,400%	17/04/2012	17/04/2017	EUR	13.123.600	13.123.600	-	1,797%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carime SpA	0,000%	02/07/2012	02/07/2017	EUR	12.123.481	12.123.481	188,90	1,867%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carime SpA	3,500%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	24.914.252	24.914.252	-	1,633%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carime SpA	2,250%	15/06/2012	15/06/2017	EUR	6.713.548	6.713.548	-	1,920%	-	Banks	100,000	IT
Banca Centro Emilia Credito Cooperativo Soc Coop	5,250%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	10.058.025	10.058.025	-	0,528%	-	Banks	100,000	IT
Banca del Centroveneto Credito Cooperativo SC	5,000%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	20.193.750	20.193.750	-	2,954%	-	Banks	100,000	IT
Banca della Marca Credito Cooperativo SC	3,700%	15/11/2012	15/11/2017	EUR	31.932.000	31.932.000	-	3,262%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	5,500%	11/01/2012	11/01/2017	EUR	380.943.000	380.943.000	-	1,029%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	4,200%	27/08/2012	31/07/2017	EUR	5.767.196	5.767.196	-	3,378%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	4,000%	29/10/2012	29/10/2017	EUR	12.899.200	12.899.200	-	3,408%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	3,750%	02/01/2012	15/01/2017	EUR	6.466.000	6.466.000	325,85	3,307%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	5,300%	27/08/2012	31/07/2017	EUR	62.521.956	62.521.956	-	3,139%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	1,862%	30/04/2012	30/04/2017	EUR	1.322.910	1.322.910	329,85	3,347%	-	Banks	100,000	IT
Banca delle Marche SpA	5,750%	23/07/2012	30/06/2017	EUR	24.270.600	24.270.600	-	3,355%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Caraglio del Cuneese Riviera dei Fiori-Credito Cooperativo-Societa Coop	3,000%	10/08/2012	10/08/2017	EUR	8.605.730	8.605.730	-	2,273%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Caraglio del Cuneese Riviera dei Fiori-Credito Cooperativo-Societa Coop	2,750%	26/10/2012	26/10/2017	EUR	10.344.000	10.344.000	-	2,319%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Cividale SpA	6,500%	23/02/2012	23/02/2017	EUR	66.576.000	66.576.000	-	6,465%	-	Banks	100,000	IT

Banca di Credito Cooperativo del Metauro SC	4,000%	13/12/2012	13/12/2017	EUR	13.069.500	13.069.500	-	3,130%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo del Polesine-Rovigo SC	5,500%	20/02/2012	20/02/2017	EUR	6.619.550	6.619.550	-	2,981%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo del Veneziano SC	4,000%	12/03/2012	12/03/2017	EUR	9.549.538	9.549.538	-	2,893%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	4,500%	05/11/2012	05/11/2017	EUR	15.334.800	15.334.800	-	3,493%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	4,000%	07/05/2012	07/05/2017	EUR	7.220.121	19.591.500	-	3,245%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	4,000%	19/11/2012	19/11/2017	EUR	15.093.912	15.362.760	-	3,471%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Cambiano Castelfiorentino Firenze SCpA	2,481%	24/10/2012	24/10/2017	EUR	6.477.100	6.477.100	157,81	1,556%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carate Brianza Societa Cooperativa	4,500%	18/01/2012	18/01/2017	EUR	64.247.930	64.247.930	-	1,540%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carate Brianza Societa Cooperativa	4,500%	04/07/2012	04/07/2017	EUR	43.900.150	43.900.150	-	1,648%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Caravaggio SC	5,200%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	13.452.200	13.452.200	-	0,505%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carugate	3,450%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	13.337.800	13.337.800	-	2,699%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carugate	4,100%	19/01/2012	19/01/2017	EUR	16.164.375	16.164.375	-	2,637%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Castagneto Carducci Scpa	4,500%	12/09/2012	12/09/2017	EUR	6.444.000	6.444.000	-	1,730%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Castenaso Bologna SC	3,500%	15/10/2012	15/10/2017	EUR	6.468.000	6.468.000	-	1,441%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Conversano SC	3,700%	30/05/2012	30/05/2017	EUR	10.824.410	10.824.410	-	2,872%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Conversano SC	4,200%	20/02/2012	20/02/2017	EUR	6.619.550	6.619.550	-	2,748%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Fano	4,500%	02/01/2012	02/01/2017	EUR	9.616.235	9.616.235	-	2,792%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Filottrano SC	4,750%	01/10/2012	01/10/2017	EUR	6.448.450	6.448.450	-	1,723%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Ghisalba SC	4,000%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	6.551.900	6.551.900	-	2,847%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Gradara SC	4,500%	26/10/2012	26/10/2017	EUR	8.968.248	8.968.248	-	3,471%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Pontassieve SC	5,000%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	13.452.200	13.452.200	-	0,495%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Roma SC	4,750%	23/04/2012	23/04/2017	EUR	18.371.255	18.371.255	-	3,038%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Roma SC	4,500%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	39.156.000	39.156.000	-	3,143%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sant Elena Padova SC	4,200%	02/04/2012	02/04/2017	EUR	6.664.250	6.664.250	-	2,742%	-	Banks	100,000	IT

Banca di Credito Cooperativo di Sant Elena Padova SC	4,000%	02/04/2012	02/04/2017	EUR	6.664.250	6.664.250	-	2,774%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sant Elena Padova SC	4,400%	20/07/2012	20/07/2017	EUR	6.086.500	6.086.500	-	2,902%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Sovicille CRAS Scrl	5,000%	22/02/2012	22/02/2017	EUR	10.595.760	10.595.760	-	2,782%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Forli Credito Cooperativo SC	5,500%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	26.821.400	26.821.400	-	1,489%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Forli Credito Cooperativo SC	3,500%	17/12/2012	17/12/2017	EUR	22.574.094	32.891.500	-	1,610%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Imola SpA	1,350%	21/03/2012	21/03/2017	EUR	13.197.700	13.197.700	-	1,307%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Verona Credito Cooperativo Cadidavid Scpa	0,750%	20/01/2012	20/01/2017	EUR	2.460.788	7.758.660	211,90	2,097%	-	Banks	100,000	IT
Banca IFIS SpA	6,400%	10/01/2012	10/01/2017	EUR	88.168.200	88.168.200	-	1,015%	-	Commercial Finance	100,000	IT
Banca IMI SpA	0,000%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	571.912.212	1.008.865.227	118,51	1,163%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	5,000%	12/09/2012	12/09/2017	EUR	501.794.280	501.794.280	-	1,302%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	5,000%	11/09/2012	11/09/2017	EUR	99.669.203	99.669.203	-	1,416%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	4,120%	17/10/2012	17/10/2017	EUR	132.501.900	132.501.900	137,74	1,425%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	3,885%	04/07/2012	04/07/2017	EUR	22.138.219	22.138.219	133,29	1,311%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	3,986%	12/09/2012	12/09/2017	EUR	59.340.218	59.340.218	140,21	1,380%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	5,000%	13/09/2012	13/09/2017	EUR	90.463.837	90.463.837	-	1,087%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	3,500%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	5.292.320.000	5.292.320.000	-	0,545%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	4,900%	01/10/2012	01/10/2017	EUR	79.286.272	79.286.272	-	2,873%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	5,000%	30/04/2012	30/04/2017	EUR	19.460.006	19.460.006	-	3,080%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	3,900%	02/07/2012	02/07/2017	EUR	11.048.133	11.048.133	-	3,173%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro International SA	0,785%	28/12/2012	28/12/2017	EUR	9.718.244	9.718.244	137,53	1,353%	-	Banks	100,000	LU
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,578%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	181.752.188	181.752.188	85,62	0,834%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,678%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	53.625.819	53.625.819	87,14	0,849%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,487%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	88.942.645	88.942.645	78,78	0,766%	-	Banks	95,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,987%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	26.003.200	26.003.200	127,95	1,258%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,985%	28/12/2012	28/12/2017	EUR	16.223.517	16.223.517	131,56	1,294%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	1,585%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	6.504.878	6.504.878	33,78	0,316%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,987%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	5.956.033	5.956.033	134,27	1,321%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	1,637%	31/08/2012	31/08/2017	EUR	4.756.791	4.756.791	130,76	1,286%	-	Banks	100,000	IT

Banca Popolare dell'Alto Adige SCpA Suedtiroler Volksbank Genossenschaft auf Akt	5,250%	03/02/2012	03/02/2017	EUR	105.114.400	105.114.400	-	0,323%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	6,800%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	17.834.275	17.834.275	-	1,601%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	0,000%	07/09/2012	07/09/2017	EUR	338.919.100	338.919.100	-	0,815%	-	Banks	78,200	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	0,000%	24/10/2012	24/10/2017	EUR	32.385.500	32.385.500	-	1,437%	-	Banks	82,590	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	4,850%	16/04/2012	16/04/2017	EUR	15.710.280	15.710.280	-	1,490%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Etruria e del Lazio SC	6,900%	03/01/2012	03/01/2017	EUR	215.303.550	215.303.550	-	2,223%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bari SCpA	5,000%	28/06/2012	28/06/2017	EUR	173.952.800	173.952.800	-	2,479%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,000%	02/04/2012	02/04/2017	EUR	45.483.506	45.483.506	-	1,408%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,000%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	19.175.321	19.175.321	-	1,398%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	2,600%	31/05/2012	31/05/2017	EUR	11.325.790	11.325.790	-	1,420%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,000%	05/03/2012	05/03/2017	EUR	25.257.911	25.257.911	-	1,397%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,000%	30/04/2012	30/04/2017	EUR	19.073.716	19.073.716	-	1,416%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,000%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	46.691.512	46.691.512	-	1,393%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bergamo SpA	3,000%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	25.355.200	25.355.200	-	1,386%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Cividale SCPA	6,500%	23/02/2012	23/02/2017	EUR	99.864.000	99.864.000	-	0,896%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Cividale SCPA	4,500%	09/03/2012	09/03/2017	EUR	41.376.165	41.376.165	-	1,575%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Lanciano e Sulmona SpA	4,750%	30/07/2012	30/07/2017	EUR	12.261.800	12.261.800	-	1,706%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Lanciano e Sulmona SpA	4,700%	16/04/2012	16/04/2017	EUR	6.545.950	6.545.950	-	1,635%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	3,750%	31/05/2012	31/05/2017	EUR	14.191.858	14.191.858	-	2,119%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	5,900%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	663.135.000	663.135.000	-	1,063%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Puglia e Basilicata SCPA	4,600%	23/07/2012	23/07/2017	EUR	43.815.714	43.815.714	-	3,539%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,000%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	29.097.530	29.097.530	-	1,381%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Spoleto SpA	6,000%	21/02/2012	21/02/2017	EUR	92.721.300	92.721.300	-	6,087%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sviluppo Scpa	5,250%	14/09/2012	14/09/2017	EUR	14.137.554	14.137.554	-	1,328%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	6,250%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	18.833.080	18.833.080	-	3,553%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Etica Scpa	2,250%	06/11/2012	06/11/2017	EUR	7.273.680	7.273.680	-	1,449%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Etica Scpa	3,000%	19/06/2012	19/06/2017	EUR	6.345.900	6.345.900	-	1,387%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	4,500%	07/05/2012	07/05/2017	EUR	39.183.000	39.183.000	-	2,791%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	4,316%	18/07/2012	18/07/2017	EUR	15.699.968	15.699.968	-	2,979%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	5,000%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	67.261.000	67.261.000	-	2,642%	-	Banks	100,000	IT

Banca Popolare Pugliese Scpa	4,500%	04/10/2012	04/10/2017	EUR	10.350.612	10.350.612	-	3,082%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	4,000%	10/12/2012	10/12/2017	EUR	7.988.721	38.811.600	-	3,131%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Sant'Angelo Scrl	4,000%	10/07/2012	30/06/2017	EUR	6.128.200	6.128.200	-	2,968%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	4,280%	06/12/2012	06/12/2017	EUR	1.059.920.958	1.059.920.958	206,35	2,041%	-	Banks	100,000	IT
Banca Reale SpA	4,000%	18/12/2012	18/12/2017	EUR	13.229.900	13.229.900	-	3,308%	-	Banks	100,000	IT
Banca San Biagio del Veneto Orientale Banca di Credito Cooperativo SC	2,550%	05/11/2012	05/11/2017	EUR	8.533.816	8.533.816	160,23	1,650%	-	Banks	100,000	IT
Banca San Giorgio Quinto Valle Agno Credito Cooperativo	4,350%	27/12/2012	27/12/2017	EUR	10.355.633	10.355.633	-	3,066%	-	Banks	100,000	IT
Banca Santo Stefano Credito Cooperativo Martellago-Venezia SC	6,500%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	30.844.610	30.844.610	-	0,443%	-	Banks	100,000	IT
Banca Sella SpA	6,000%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	131.038.000	131.038.000	-	0,946%	-	Banks	100,000	IT
Banca Tercas SpA	6,500%	05/01/2012	05/01/2017	EUR	127.950.000	127.950.000	-	1,399%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	4,250%	02/07/2012	02/07/2017	EUR	25.183.800	25.183.800	-	1,536%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	4,750%	02/01/2012	02/01/2017	EUR	25.864.000	25.864.000	-	1,453%	-	Banks	100,000	IT
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	3,500%	05/12/2012	05/12/2017	EUR	2.617.180.000	2.617.180.000	-	0,094%	-	Banks	100,000	ES
Banco BPI SA	0,631%	20/07/2012	20/07/2017	EUR	973.840.000	973.840.000	82,49	0,803%	NR	Banks	100,000	PT
Banco Cooperativo Espanol SA	2,485%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	1.187.064.200	1.187.064.200	55,96	0,538%	-	Banks	100,000	ES
Banco di Brescia SpA	0,000%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	67.312.500	67.312.500	206,68	2,045%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,487%	15/06/2012	15/06/2017	EUR	16.423.810	16.423.810	368,41	3,662%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,250%	20/04/2012	20/04/2017	EUR	1.886.659	26.423.800	-	1,311%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	3,550%	10/04/2012	10/04/2017	EUR	52.360.400	52.360.400	-	1,327%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	3,500%	20/11/2012	20/11/2017	EUR	23.502.852	38.418.000	-	1,497%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	31/07/2012	31/07/2017	EUR	366.906.041	366.906.041	-	1,771%	-	Banks	80,000	IT
Banco Popolare SC	6,550%	31/08/2012	30/08/2017	EUR	142.175.748	142.175.748	-	2,004%	NR	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	30/04/2012	30/04/2017	EUR	145.879.932	145.879.932	-	1,788%	-	Banks	86,700	IT
Banco Popolare SC	0,000%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	365.177.239	365.177.239	-	1,624%	-	Banks	85,000	IT
Banco Popolare SC	3,700%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	2.122.032.000	2.122.032.000	-	0,832%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	51.784.748	51.784.748	-	1,893%	-	Banks	88,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	28/09/2012	28/09/2017	EUR	217.703.623	217.703.623	-	1,874%	-	Banks	83,750	IT
Banco Popolare SC	2,986%	28/12/2012	15/12/2017	EUR	33.200.693	33.200.693	201,82	1,996%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,990%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	125.308.121	125.308.121	195,98	1,938%	-	Banks	100,000	IT

Banco Popolare SC	2,986%	28/12/2012	14/12/2017	EUR	6.650.716	6.650.716	208,58	2,064%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	31/08/2012	31/08/2017	EUR	146.982.822	146.982.822	-	1,893%	-	Banks	85,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	80.737.336	80.737.336	197,49	1,953%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,387%	04/09/2012	04/09/2017	EUR	54.012.300	54.012.300	192,85	1,907%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,734%	08/10/2012	08/10/2017	EUR	1.427.140	1.427.140	209,07	2,069%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,641%	16/11/2012	16/11/2017	EUR	890.589	890.589	211,76	2,096%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,549%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	30.742.173	30.742.173	181,11	1,859%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,049%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	1.075.344	1.075.344	195,42	2,002%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,385%	28/09/2012	29/09/2017	EUR	31.365.205	31.365.205	197,11	1,949%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,391%	30/11/2012	17/11/2017	EUR	94.131.584	94.131.584	196,04	1,938%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,387%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	33.284.096	33.284.096	201,42	1,992%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,387%	31/08/2012	31/08/2017	EUR	46.889.084	46.889.084	193,13	1,909%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,385%	28/09/2012	28/09/2017	EUR	40.391.071	40.391.071	195,98	1,938%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,378%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	109.075.177	109.075.177	194,19	1,920%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popular Espanol SA	4,125%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	1.333.240.000	1.333.240.000	-	0,140%	-	Banks	99,580	ES
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	1,350%	14/11/2012	14/11/2017	EUR	25.491.800	25.491.800	-	0,292%	-	Banks	100,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	3,000%	23/02/2012	23/02/2017	EUR	13.315.200	13.315.200	-	1,039%	-	Banks	100,000	AT
Bank Nederlandse Gemeenten NV	0,331%	27/04/2012	27/04/2017	EUR	37.779.885	37.779.885	9,72	0,075%	AA+	Government Development Banks	100,000	NL
Bankhaus Neelmeyer AG	0,000%	24/01/2012	24/01/2017	EUR	13.022.000	13.022.000	95,80	0,936%	-	Banks	100,000	DE
Bankinter SA	4,125%	22/03/2012	22/03/2017	EUR	1.318.340.000	1.318.340.000	-	0,134%	A	Banks	99,721	ES
Bankinter SA	3,989%	20/11/2012	20/11/2017	EUR	768.360.000	768.360.000	15,15	0,129%	A	Banks	100,000	ES
Banque Accord SA	1,817%	13/12/2012	15/11/2017	EUR	196.042.500	196.042.500	-	1,076%	-	Banks	100,000	FR
Banque Federative du Credit Mutuel SA	2,875%	21/06/2012	21/06/2017	EUR	1.068.135.500	1.068.135.500	-	0,294%	A	Banks	99,510	FR
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4,050%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	393.114.000	393.114.000	-	0,721%	-	Banks	100,000	FR
Banque Federative du Credit Mutuel SA	1,116%	13/11/2012	13/11/2017	EUR	127.096.000	127.096.000	39,95	0,377%	A	Banks	100,000	FR
Banque PSA Finance SA	4,610%	15/06/2012	15/06/2017	EUR	25.267.400	25.267.400	-	1,956%	-	Automobiles Manufacturing	100,000	FR
Barclays Bank PLC	2,250%	22/02/2012	22/02/2017	EUR	2.648.940.000	2.648.940.000	-	0,008%	AAA	Banks	99,682	GB
Barclays Bank PLC	2,850%	10/02/2012	10/02/2017	EUR	3.598.058	19.791.300	69,62	0,674%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,641%	10/02/2012	10/02/2017	EUR	4.393.669	42.221.440	64,87	0,627%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,328%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	1.019.522	7.842.480	75,42	0,732%	-	Banks	100,000	GB

Barclays Bank PLC	1,741%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	7.194.527	58.707.076	63,13	0,609%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,450%	24/01/2012	24/01/2017	EUR	1.726.717	2.801.032	73,66	0,715%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,000%	02/05/2012	02/05/2017	EUR	39.501.000	39.501.000	60,65	0,584%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,000%	21/03/2012	21/03/2017	EUR	518.670	26.395.400	96,41	0,942%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	0,000%	30/10/2012	30/10/2017	EUR	55.749	3.163.411	74,07	0,719%	A-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,350%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	7.698.694	9.582.002	-	0,638%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,736%	03/01/2012	03/01/2017	EUR	1.174.383	142.818.022	66,72	0,645%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,500%	11/01/2012	11/01/2017	EUR	31.745.250	31.745.250	63,33	0,611%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,570%	03/01/2012	03/01/2017	EUR	1.696.331	1.696.331	71,46	0,693%	-	Banks	94,430	GB
Barclays Bank PLC	3,250%	27/01/2012	27/01/2017	EUR	1.869.391	1.869.391	73,93	0,717%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,700%	25/05/2012	25/05/2017	EUR	12.514.700	12.514.700	-	0,621%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	2,300%	27/06/2012	27/06/2017	EUR	3.841.022	5.028.632	-	0,670%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	3,000%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	3.581.480	32.881.750	72,20	0,700%	-	Banks	100,000	GB
Barclays Bank PLC	1,600%	28/08/2012	28/08/2017	EUR	1.382.810	1.382.810	-	0,692%	-	Banks	100,000	GB
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	3,000%	20/02/2012	20/02/2017	EUR	66.195.500	66.195.500	-	1,081%	-	Banks	100,150	AT
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	2,125%	20/02/2012	20/02/2017	EUR	66.195.500	66.195.500	-	0,293%	-	Banks	99,600	AT
Bayerische Landesbank	1,250%	16/10/2012	16/10/2017	EUR	260.906.000	260.906.000	-	0,412%	-	Banks	99,590	DE
Bayerische Landesbank	1,650%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	63.255.500	63.255.500	-	0,620%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	0,407%	28/11/2012	28/11/2017	EUR	258.826.000	258.826.000	51,61	0,494%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	2,250%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	67.053.500	67.053.500	61,52	0,593%	-	Banks	101,000	DE
Bayerische Landesbank	0,069%	11/07/2012	11/07/2017	EUR	122.536.000	122.536.000	6,07	0,109%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	0,800%	03/02/2012	03/02/2017	EUR	131.393.000	131.393.000	32,60	0,495%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,001%	13/02/2012	13/02/2017	EUR	264.174.000	264.174.000	47,42	0,452%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	0,341%	24/07/2012	24/07/2017	EUR	120.526.000	120.526.000	34,95	0,518%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,350%	21/11/2012	21/11/2017	EUR	64.138.500	64.138.500	-	0,656%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,000%	24/10/2012	24/10/2017	EUR	129.542.000	129.542.000	-	0,239%	-	Banks	100,050	DE
Bayerische Landesbank	0,258%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	130.708.000	130.708.000	8,24	0,130%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,650%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	61.497.500	61.497.500	-	0,627%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	0,526%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	264.616.000	264.616.000	40,56	0,454%	-	Banks	100,000	DE

Bayerische Landesbank	0,000%	06/06/2012	06/06/2017	EUR	125.591.000	125.591.000	-2,78	0,141%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,780%	22/03/2012	22/03/2017	EUR	98.875.500	98.875.500	59,72	0,575%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,850%	25/04/2012	25/04/2017	EUR	66.005.500	66.005.500	-	0,612%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	2,125%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	266.334.000	266.334.000	-	0,491%	-	Banks	99,655	DE
Bayerische Landesbank	2,000%	28/03/2012	28/03/2017	EUR	66.531.500	66.531.500	-	0,610%	-	Banks	100,500	DE
Bayerische Landesbank	2,800%	12/01/2012	12/01/2017	EUR	64.170.000	64.170.000	-	0,617%	-	Banks	101,000	DE
Bayerische Landesbank	2,250%	07/03/2012	07/03/2017	EUR	65.716.500	65.716.500	-	0,613%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,000%	14/11/2012	14/11/2017	EUR	63.729.500	63.729.500	64,49	0,623%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,200%	12/12/2012	12/12/2017	EUR	65.440.500	65.440.500	-	0,659%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	0,486%	16/10/2012	16/10/2017	EUR	260.906.000	260.906.000	42,20	0,470%	-	Banks	100,000	DE
BCC Carso-ZKB SC	5,000%	15/01/2012	15/01/2017	EUR	8.870.960	8.870.960	-	3,227%	-	Banks	100,000	IT
BCC Castiglione Messer Raimondo e Pianella SCRL	5,000%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	6.731.250	6.731.250	-	0,531%	-	Banks	100,000	IT
Belfius Bank SA/NV	1,250%	27/11/2012	27/11/2017	EUR	1.617.325.000	1.617.325.000	-	0,083%	AAA	Banks	99,678	BE
Belfius Financing Co	3,350%	25/04/2012	25/04/2017	EUR	3.960.330	3.960.330	-	1,665%	-	Banks	100,000	LU
Berentzen-Gruppe AG	6,500%	18/10/2012	18/10/2017	EUR	65.512.500	65.512.500	-	1,869%	-	Food & Beverage	100,000	DE
BKS Bank AG	3,000%	06/03/2012	06/03/2017	EUR	39.343.800	39.343.800	-	1,122%	-	Banks	100,000	AT
BKS Bank AG	3,000%	12/06/2012	12/06/2017	EUR	35.956.224	35.956.224	-	1,155%	-	Banks	100,000	AT
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	2,000%	05/09/2012	05/09/2017	EUR	25.209.200	25.209.200	66,39	0,642%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	2,000%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	25.302.200	25.302.200	64,58	0,624%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	2,000%	08/08/2012	08/08/2017	EUR	24.735.200	24.735.200	68,76	0,666%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	2,150%	22/08/2012	22/08/2017	EUR	24.934.600	24.934.600	-	0,701%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	2,500%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	24.599.000	24.599.000	-	0,702%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	2,000%	05/09/2012	05/09/2017	EUR	25.209.200	25.209.200	-	0,703%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	2,100%	08/08/2012	08/08/2017	EUR	24.735.200	24.735.200	-	0,694%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	1,250%	21/11/2012	21/11/2017	EUR	25.655.400	25.655.400	66,97	0,648%	-	Banks	100,750	DE

BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	1,250%	21/12/2012	21/12/2017	EUR	26.338.000	26.338.000	67,91	0,657%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Home Loan SFH SA	0,300%	28/12/2012	15/12/2017	EUR	26.444.200	26.444.200	-	0,217%	AAA	Financial Services	97,010	FR
BNP Paribas Home Loan SFH SA	1,038%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	33.656.250	33.656.250	12,80	0,106%	AAA	Financial Services	100,000	FR
BNP Paribas Home Loan SFH SA	1,078%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	134.625.000	134.625.000	15,32	0,131%	AAA	Financial Services	100,000	FR
BNP Paribas SA	3,000%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	1.682.812.500	1.682.812.500	-	0,255%	A+	Diversified Banks	99,703	FR
BNP Paribas SA	1,185%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	147.608.333	147.608.333	54,74	0,525%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,941%	15/11/2012	15/11/2017	EUR	383.184.000	383.184.000	33,61	0,314%	A+	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,435%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	37.039.891	37.039.891	35,91	0,337%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,136%	21/09/2012	21/09/2017	EUR	1.300.250.000	1.300.250.000	15,18	0,130%	A+	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,578%	17/08/2012	17/08/2017	EUR	4.023.091	4.023.091	69,54	0,621%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,079%	30/04/2012	30/04/2017	EUR	8.598.915	8.598.915	90,16	0,880%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,300%	18/10/2012	18/10/2017	EUR	4.152.182	4.152.182	66,40	0,642%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	2,000%	24/10/2012	24/10/2017	EUR	6.477.100	6.477.100	67,51	0,653%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,357%	07/06/2012	07/06/2017	EUR	43.979.950	43.979.950	48,59	0,464%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,085%	04/10/2012	04/10/2017	EUR	195.270.000	195.270.000	49,93	0,477%	A+	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,049%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	4.383.606	4.383.606	49,94	0,547%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	2,150%	27/08/2012	27/08/2017	EUR	10.588.416	10.588.416	63,14	0,609%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,361%	15/06/2012	15/06/2017	EUR	12.633.700	12.633.700	25,12	0,420%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,450%	21/11/2012	21/11/2017	EUR	1.282.770	1.282.770	-	0,697%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	2,830%	25/06/2012	25/06/2017	EUR	43.742.300	43.742.300	56,36	0,542%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,700%	26/09/2012	26/09/2017	EUR	1.416.150	1.416.150	-	0,678%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BPCE SA	2,625%	05/04/2012	05/04/2017	EUR	26.126.000	26.126.000	-	0,749%	-	Banks	100,000	FR
BPCE SFH SA	2,000%	23/07/2012	23/07/2017	EUR	127.420.650	127.420.650	-	0,201%	AAA	Banks	100,000	FR
BPCE SFH SA	1,291%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	39.311.400	39.311.400	23,41	0,212%	AAA	Banks	100,000	FR
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,210%	06/03/2012	06/03/2017	EUR	65.573.000	65.573.000	-2,67	0,021%	-	Banks	99,610	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,750%	14/08/2012	14/08/2017	EUR	123.338.000	123.338.000	-	0,492%	-	Banks	99,830	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,636%	19/06/2012	19/06/2017	EUR	63.459.000	63.459.000	19,99	0,369%	-	Banks	99,900	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,138%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	67.261.000	67.261.000	32,09	0,369%	-	Banks	100,000	DE

Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,593%	05/07/2012	05/07/2017	EUR	61.966.500	61.966.500	20,57	0,375%	-	Banks	99,860	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,750%	20/06/2012	20/06/2017	EUR	63.461.500	63.461.500	-	0,492%	-	Banks	99,800	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,877%	06/03/2012	06/03/2017	EUR	65.573.000	65.573.000	17,78	0,347%	-	Banks	99,625	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	2,500%	06/03/2012	06/03/2017	EUR	65.573.000	65.573.000	-	0,474%	-	Banks	99,800	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,831%	09/05/2012	09/05/2017	EUR	129.511.000	129.511.000	29,21	0,340%	-	Banks	99,855	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,089%	28/03/2012	28/03/2017	EUR	66.531.500	66.531.500	32,54	0,373%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,936%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	66.650.500	66.650.500	18,70	0,356%	-	Banks	99,950	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,375%	22/11/2012	22/11/2017	EUR	64.294.500	64.294.500	-	0,552%	-	Banks	99,980	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,870%	05/12/2012	05/12/2017	EUR	65.429.500	65.429.500	-	0,166%	-	Banks	99,975	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	2,500%	10/01/2012	10/01/2017	EUR	63.890.000	63.890.000	-	0,454%	-	Banks	99,540	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	2,150%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	66.583.500	66.583.500	-	0,177%	-	Banks	99,970	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,630%	23/10/2012	23/10/2017	EUR	64.878.500	64.878.500	-	0,544%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,970%	02/11/2012	02/11/2017	EUR	64.135.000	64.135.000	-	0,163%	-	Banks	99,980	DE
BSA SA	3,150%	19/12/2012	19/12/2017	EUR	170.194.395	170.194.395	-	1,792%	-	Food & Beverage	100,000	FR
Bureau Veritas SA	3,750%	24/05/2012	24/05/2017	EUR	627.265.000	627.265.000	-	0,736%	-	Consumer Services	99,464	FR
CaixaBank SA	4,000%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	1.310.380.000	1.310.380.000	-	0,096%	A	Banks	99,530	ES
CaixaBank SA	6,500%	25/01/2012	25/01/2017	EUR	0	1.304.780.000	-	0,411%	A	Banks	100,000	ES
CaixaBank SA	6,500%	01/02/2012	01/02/2017	EUR	329.600.000	329.600.000	-	0,270%	NR	Banks	100,000	ES
Cajas Rurales Unidas SCC	5,500%	03/07/2012	03/07/2017	EUR	945.870.000	945.870.000	-	0,373%	BBB+	Banks	100,000	ES
Cajas Rurales Unidas SCC	5,000%	14/02/2012	14/02/2017	EUR	426.335.000	426.335.000	-	0,366%	-	Banks	100,000	ES
Carrefour SA	1,875%	19/12/2012	19/12/2017	EUR	1.324.470.000	1.324.470.000	-	0,348%	BBB+	Supermarkets & Pharmacies	99,613	FR
Cassa Centrale Banca Credito Cooperativo del Nord Est SpA	6,000%	20/02/2012	20/02/2017	EUR	66.195.500	66.195.500	-	0,435%	-	Banks	100,000	IT

Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	6,000%	23/02/2012	23/02/2017	EUR	66.576.000	66.576.000	-	0,429%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	2,491%	15/05/2012	15/05/2017	EUR	7.661.640	7.661.640	304,13	3,019%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Depositi e Prestiti SpA	4,250%	30/10/2012	30/10/2017	EUR	64.824.000	64.824.000	-	0,604%	-	Government Development Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	5,800%	20/02/2012	20/02/2017	EUR	79.434.600	79.434.600	-	0,690%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	4,400%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	7.967.588	7.967.588	-	3,249%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	3,500%	17/09/2012	17/09/2017	EUR	13.117.600	13.117.600	-	1,671%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	6,500%	20/02/2012	20/02/2017	EUR	132.391.000	132.391.000	-	0,757%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	3,000%	22/10/2012	22/10/2017	EUR	13.059.200	13.059.200	-	1,681%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	2,750%	21/12/2012	21/12/2017	EUR	14.761.132	14.761.132	409,45	4,143%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	3,000%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	38.909.100	38.909.100	-	4,064%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	0,986%	02/01/2012	02/01/2017	EUR	71.126	1.448.384	420,49	4,183%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Cesena SpA/Old	0,000%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	6.192.050	6.192.050	-	1,426%	-	Banks	84,050	IT
Cassa di Risparmio di Fano SpA	4,500%	28/11/2012	28/11/2017	EUR	12.941.300	12.941.300	-	3,793%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ferrara SpA	4,500%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	165.783.750	165.783.750	-	1,154%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ferrara SpA	5,100%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	10.054.651	10.054.651	-	1,686%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ferrara SpA	5,100%	20/08/2012	20/08/2017	EUR	362.822	6.170.450	-	1,875%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ravenna SpA	5,750%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	118.163.700	118.163.700	-	0,457%	-	Financial Services	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ravenna SpA	3,500%	08/03/2012	08/03/2017	EUR	26.525.400	26.525.400	-	1,261%	-	Financial Services	100,000	IT
Cassa di Risparmio di San Miniato SpA	4,500%	23/07/2012	23/07/2017	EUR	6.708.394	6.708.394	-	1,537%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	4,750%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	6.551.900	6.551.900	-	4,457%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	3,250%	19/03/2012	19/03/2017	EUR	13.242.400	13.242.400	-	4,330%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	4,000%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	6.731.250	6.731.250	-	4,424%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	3,400%	03/12/2012	03/12/2017	EUR	6.527.600	6.527.600	-	4,408%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio Fabriano e Cupramontana SpA	3,000%	06/02/2012	06/02/2017	EUR	6.564.100	6.564.100	244,34	2,491%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	5,500%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	263.054.000	263.054.000	-	0,530%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Alta ValdiSole e Pejo BCC SC	2,500%	03/05/2012	03/05/2017	EUR	10.516.240	10.516.240	160,37	1,652%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Alta ValdiSole e Pejo BCC SC	3,250%	16/08/2012	16/08/2017	EUR	8.652.560	8.652.560	-	1,757%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Banca di Credito Cooperativo di Treviglio SC	4,500%	17/09/2012	17/09/2017	EUR	34.913.804	34.913.804	-	1,968%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Banca di Credito Cooperativo di Treviglio SC	4,000%	08/10/2012	08/10/2017	EUR	15.609.019	15.609.019	-	2,005%	-	Banks	100,000	IT

Cassa Rurale Bassa Vallagarina Banca di Credito Cooperativo SC	0,798%	02/02/2012	02/02/2017	EUR	3.256.287	3.256.287	289,73	2,945%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Centrofiemme Cavalese BCC SC	3,500%	01/09/2012	01/09/2017	EUR	10.078.240	10.078.240	-	2,119%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Pergine - BCC Soc Coop	3,000%	03/12/2012	03/12/2017	EUR	6.527.600	6.527.600	-	1,625%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	4,000%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	6.253.971	18.576.150	-	2,888%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	4,000%	05/11/2012	05/11/2017	EUR	13.433.285	19.168.500	-	3,036%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Cantu'Banca di Credito Cooperativo SC	3,250%	12/11/2012	12/11/2017	EUR	19.069.350	19.069.350	-	1,635%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Cantu'Banca di Credito Cooperativo SC	4,500%	20/01/2012	20/01/2017	EUR	32.327.750	32.327.750	-	1,467%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Cantu'Banca di Credito Cooperativo SC	4,000%	26/03/2012	26/03/2017	EUR	19.992.300	19.992.300	-	1,505%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Cortina d'Ampezzo e delle Dolomiti Credito Cooperat	0,850%	01/07/2012	01/07/2017	EUR	4.330.354	7.555.140	300,84	2,986%	-	Banks	100,000	IT
CE Credit Management BV	8,000%	30/06/2012	30/06/2017	EUR	12.591.900	12.591.900	-	4,526%	-	Financial Services	100,000	NL
ChiantiBanca-Credito Cooperativo SC	4,500%	13/06/2012	13/06/2017	EUR	12.581.400	12.581.400	-	1,366%	-	Banks	100,000	IT
ChiantiBanca-Credito Cooperativo SC	4,000%	13/06/2012	13/06/2017	EUR	12.581.400	12.581.400	-	1,353%	-	Banks	100,000	IT
ChiantiBanca-Credito Cooperativo SC	4,500%	10/07/2012	10/07/2017	EUR	12.256.400	12.256.400	-	1,381%	-	Banks	100,000	IT
CIC	2,500%	15/05/2012	15/05/2017	EUR	6.576.241	6.576.241	65,74	0,635%	-	Banks	100,000	FR
CIC	0,736%	15/03/2012	15/03/2017	EUR	2.620.260	2.620.260	60,28	0,581%	-	Banks	100,000	FR
CIC	3,300%	26/03/2012	26/03/2017	EUR	3.998.460	3.998.460	67,50	0,653%	-	Banks	100,000	FR
CIC	3,300%	26/03/2012	26/03/2017	EUR	19.992.300	19.992.300	60,60	0,584%	-	Banks	100,000	FR
CIC	3,650%	19/06/2012	19/06/2017	EUR	19.037.700	19.037.700	-	0,643%	-	Banks	100,000	FR
CIC	2,900%	07/03/2012	07/03/2017	EUR	1.314.330	1.314.330	-	0,683%	-	Banks	100,000	FR
Citycon OYJ	4,250%	11/05/2012	11/05/2017	EUR	179.113.128	194.125.500	-	0,719%	-	Real Estate	99,956	FI
Clariant Finance Luxembourg SA	5,625%	24/01/2012	24/01/2017	EUR	651.100.000	651.100.000	-	0,612%	BBB-	Chemicals	99,724	LU
Commerzbank AG	9,500%	14/03/2012	14/03/2017	EUR	221.300.900	221.300.900	-	1,986%	BB+	Banks	101,500	DE
Commerzbank AG	10,000%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	232.388.610	232.388.610	-	2,070%	BB+	Banks	101,500	DE
Commerzbank AG	-	02/05/2012	02/05/2017	EUR	6.583.500	6.583.500	110,96	1,088%	BBB+	Banks	101,000	DE
Commerzbank AG	0,000%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	1.346.318	1.346.318	114,07	1,119%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,000%	26/06/2012	26/06/2017	EUR	6.247.250	6.247.250	54,22	0,520%	NR	Banks	100,000	DE

Commerzbank AG	2,300%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	2.666.020	2.666.020	59,94	0,647%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	3,000%	07/02/2012	07/02/2017	EUR	4.640.335	4.640.335	-	0,632%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	2,800%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	7.599.468	7.599.468	-	0,621%	BBB+	Banks	100,000	DE
Comunidad Autonoma de Canarias	2,000%	03/12/2012	03/12/2017	EUR	66.979.704	66.979.704	-	1,209%	-	Government Local	100,000	ES
Constantia Flexibles AG	4,250%	25/05/2012	25/05/2017	EUR	161.589.806	187.720.500	-	2,726%	-	Containers & Packaging	101,450	AT
Conwert Immobilien Invest SE	5,750%	19/06/2012	19/06/2017	EUR	82.496.700	82.496.700	-	2,998%	-	Real Estate	101,436	AT
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands	0,685%	27/09/2012	27/09/2017	EUR	644.800.000	644.800.000	20,95	0,187%	A+	Banks	99,900	NL
Coventry Building Society	2,250%	04/12/2012	04/12/2017	EUR	654.620.000	654.620.000	-	0,530%	-	Banks	99,557	GB
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	1,882%	10/01/2012	10/01/2017	EUR	2.300.040	2.300.040	50,61	0,484%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	2,750%	19/07/2012	19/07/2017	EUR	1.227.850	1.227.850	64,35	0,621%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	1,781%	23/04/2012	23/04/2017	EUR	4.978.696	4.978.696	50,62	0,484%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	2,800%	13/07/2012	13/07/2017	EUR	24.463.200	24.463.200	-	0,609%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	2,027%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	2.521.398	2.521.398	57,10	0,549%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	2,500%	20/07/2012	20/07/2017	EUR	8.418.847	8.418.847	-	0,962%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	2,100%	06/11/2012	06/11/2017	EUR	128.148.000	128.148.000	115,60	1,134%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,100%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	135.472.810	135.472.810	66,51	0,643%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,000%	15/03/2012	15/03/2017	EUR	14.149.404	14.149.404	87,77	0,856%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	3,240%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	18.422.700	18.422.700	-	0,961%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,800%	14/12/2012	14/12/2017	EUR	6.584.050	6.584.050	105,00	1,028%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole SA	5,100%	05/06/2012	06/06/2017	EUR	368.569.693	368.569.693	-	0,969%	-	Diversified Banks	100,809	FR
Credit Agricole SA/London	1,875%	18/10/2012	18/10/2017	EUR	1.637.812.500	1.637.812.500	-	0,301%	A	Diversified Banks	99,646	GB
Credit Agricole SA/London	2,020%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	19.578.000	19.578.000	-	0,926%	A	Diversified Banks	100,000	GB
Credit Mutuel Arkea SA	4,500%	23/01/2012	23/01/2017	EUR	975.795.000	975.795.000	-	0,269%	A	Banks	100,000	FR
Credit Suisse AG	2,150%	09/05/2012	09/05/2017	EUR	64.755.500	64.755.500	-	0,618%	-	Banks	100,000	CH
Credit Suisse AG	2,500%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	1.960.620	1.960.620	53,69	0,585%	-	Banks	100,000	CH
Credit Suisse AG/Guernsey	2,125%	18/01/2012	18/01/2017	EUR	1.606.262.500	1.606.262.500	-	0,057%	-	Financial Services	99,434	GG
Credit Suisse AG/London	2,700%	08/05/2012	08/05/2017	EUR	130.100.000	130.100.000	-	0,599%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	1,800%	27/04/2012	27/04/2017	EUR	17.918.270	17.918.270	56,64	0,544%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,400%	02/02/2012	02/02/2017	EUR	12.520.133	12.520.133	57,04	0,548%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,350%	26/04/2012	26/04/2017	EUR	11.280.361	11.280.361	-	0,691%	-	Banks	100,000	GB

Credit Suisse AG/London	2,700%	22/05/2012	24/05/2017	EUR	127.358.000	127.358.000	-	1,026%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	1,700%	25/07/2012	25/07/2017	EUR	5.071.051	5.071.051	-	0,730%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,850%	01/02/2012	01/02/2017	EUR	9.980.288	9.980.288	-	0,687%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,000%	04/05/2012	04/05/2017	EUR	130.882.000	130.882.000	41,49	0,463%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,400%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	6.338.800	6.338.800	59,34	0,571%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	2,750%	28/03/2012	28/03/2017	EUR	13.408.759	13.408.759	-	0,686%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	1,250%	28/06/2012	28/06/2017	EUR	7.161.885	7.161.885	60,42	0,582%	-	Banks	100,000	GB
Credit Suisse AG/London	1,400%	06/09/2012	06/09/2017	EUR	63.157.000	63.157.000	-	0,581%	-	Banks	100,000	GB
Credito Bergamasco SpA	4,000%	31/12/2012	31/12/2017	EUR	14.065.469	14.065.469	282,51	2,803%	-	Banks	100,000	IT
Credito Bergamasco SpA	1,990%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	15.426.398	15.426.398	227,40	2,252%	-	Banks	100,000	IT
Credito Bergamasco SpA	0,000%	31/07/2012	31/07/2017	EUR	61.319.801	61.319.801	-	2,150%	-	Banks	80,000	IT
Credito Bergamasco SpA	0,000%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	10.972.050	10.972.050	230,15	2,280%	-	Banks	100,000	IT
Credito Bergamasco SpA	0,000%	31/08/2012	31/08/2017	EUR	10.753.062	10.753.062	223,61	2,214%	-	Banks	100,000	IT
Credito Bergamasco SpA	0,000%	28/09/2012	28/09/2017	EUR	31.208.122	31.208.122	-	2,235%	-	Banks	83,750	IT
Credito Bergamasco SpA	0,000%	31/08/2012	31/08/2017	EUR	15.616.705	15.616.705	-	2,239%	-	Banks	85,000	IT
Credito Cooperativo di Brescia SC	4,000%	10/04/2012	10/04/2017	EUR	14.755.161	14.755.161	-	1,451%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	5,250%	28/09/2012	28/09/2017	EUR	160.946.250	160.946.250	-	3,065%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	5,500%	18/06/2012	18/06/2017	EUR	628.140.000	628.140.000	-	0,889%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	4,250%	17/10/2012	17/10/2017	EUR	29.517.750	29.517.750	-	3,091%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	4,500%	17/10/2012	17/10/2017	EUR	29.517.750	29.517.750	-	3,104%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	4,000%	05/12/2012	05/12/2017	EUR	23.040.344	39.257.700	-	3,185%	-	Banks	100,000	IT
Danone SA	1,125%	27/11/2012	27/11/2017	EUR	970.395.000	970.395.000	-	0,298%	A-	Food & Beverage	99,749	FR
Danone SA	1,100%	12/09/2012	12/09/2017	EUR	122.436.000	122.436.000	-	0,441%	A-	Food & Beverage	100,000	FR
Danske Bank A/S	3,875%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	1.345.220.000	1.345.220.000	-	0,254%	A	Banks	99,808	DK
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,000%	23/05/2012	23/06/2017	EUR	6.280.200	6.280.200	54,79	0,526%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,065%	22/06/2012	22/06/2017	EUR	12.562.200	12.562.200	33,11	0,379%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,305%	15/03/2012	15/03/2017	EUR	13.101.300	13.101.300	52,13	0,690%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,600%	18/05/2012	23/06/2017	EUR	6.365.500	6.365.500	-	0,534%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,528%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	13.070.800	13.070.800	66,75	0,715%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,501%	01/02/2012	01/02/2017	EUR	13.184.000	13.184.000	52,77	0,697%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,125%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	13.103.800	13.103.800	-	0,780%	-	Banks	100,000	DE

DekaBank Deutsche Girozentrale	2,125%	25/01/2012	25/01/2017	EUR	6.523.900	6.523.900	-	0,814%	-	Banks	99,835	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	3,330%	03/09/2012	25/09/2017	EUR	5.039.120	5.039.120	-	0,995%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,893%	25/09/2012	25/09/2017	EUR	12.952.000	12.952.000	41,89	0,588%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,000%	31/10/2012	20/10/2017	EUR	19.454.550	19.454.550	-	0,708%	-	Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,181%	27/01/2012	27/01/2017	EUR	111.979.000	111.979.000	51,83	0,496%	BBB+	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,400%	26/07/2012	26/07/2017	EUR	14.734.200	14.734.200	-	0,619%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,177%	02/08/2012	02/08/2017	EUR	121.640.000	121.640.000	4,32	0,021%	NR	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,000%	12/07/2012	12/07/2017	EUR	6.098.850	6.098.850	94,93	0,927%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,600%	12/07/2012	12/07/2017	EUR	10.611.999	10.611.999	-	0,617%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,000%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	23.453.560	23.453.560	102,15	1,000%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,650%	28/06/2012	28/06/2017	EUR	11.803.940	11.803.940	-	0,611%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,200%	20/09/2012	20/09/2017	EUR	3.494.340	3.494.340	-	0,646%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,179%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	72.211.150	72.211.150	51,98	0,498%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,200%	06/09/2012	06/09/2017	EUR	3.978.891	3.978.891	-	0,688%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,200%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	3.561.722	3.561.722	-	0,622%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,200%	23/08/2012	23/08/2017	EUR	3.269.942	3.269.942	-	0,630%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,163%	23/08/2012	23/08/2017	EUR	31.441.750	31.441.750	3,65	0,014%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,087%	09/03/2012	09/03/2017	EUR	131.178.000	131.178.000	53,78	0,516%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,000%	28/06/2012	28/06/2017	EUR	7.455.120	7.455.120	90,45	0,883%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,081%	18/01/2012	18/01/2017	EUR	19.275.150	19.275.150	51,31	0,491%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,100%	04/10/2012	04/10/2017	EUR	2.994.140	2.994.140	-	0,573%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,000%	18/10/2012	18/10/2017	EUR	1.310.250	1.310.250	-	0,741%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	2,000%	05/01/2012	05/01/2017	EUR	24.054.600	24.054.600	36,95	0,539%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,913%	17/01/2012	17/01/2017	EUR	12.732.900	12.732.900	29,51	0,464%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,982%	25/01/2012	25/01/2017	EUR	13.047.800	13.047.800	30,50	0,474%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,048%	02/02/2012	02/02/2017	EUR	76.278.120	76.278.120	37,72	0,425%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,000%	23/08/2012	23/08/2017	EUR	1.886.505	1.886.505	90,87	0,887%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,561%	28/03/2012	28/03/2017	EUR	13.306.300	13.306.300	32,24	0,491%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,002%	25/01/2012	25/01/2017	EUR	13.047.800	13.047.800	30,55	0,475%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,102%	08/02/2012	08/02/2017	EUR	13.272.600	13.272.600	45,55	0,504%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,902%	08/02/2012	08/02/2017	EUR	9.290.820	9.290.820	31,04	0,479%	-	Diversified Banks	100,000	DE

Deutsche Bank AG/London	2,000%	09/02/2012	09/02/2017	EUR	81.242.226	81.242.226	67,65	0,846%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,600%	14/06/2012	14/06/2017	EUR	5.794.482	5.794.482	-	0,871%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,200%	17/05/2012	17/05/2017	EUR	6.484.446	6.484.446	66,77	0,837%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,700%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	5.696.686	5.696.686	-	0,869%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,500%	05/01/2012	05/01/2017	EUR	12.347.175	12.347.175	-	0,838%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,500%	19/01/2012	19/01/2017	EUR	19.526.565	19.526.565	-	0,843%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,500%	03/05/2012	03/05/2017	EUR	15.117.095	15.117.095	67,35	0,842%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,000%	19/01/2012	19/01/2017	EUR	44.742.990	44.742.990	66,88	0,838%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,100%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	12.997.446	12.997.446	-	0,853%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,400%	09/02/2012	09/02/2017	EUR	32.044.806	32.044.806	-	0,849%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,900%	17/05/2012	17/05/2017	EUR	5.467.278	5.467.278	-	0,840%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,600%	08/03/2012	08/03/2017	EUR	22.811.844	22.811.844	66,09	0,830%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,100%	12/04/2012	12/04/2017	EUR	11.727.619	11.727.619	-	0,861%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	1,500%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	20.026.677	20.026.677	65,95	0,829%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,000%	23/02/2012	23/02/2017	EUR	26.630.400	26.630.400	68,09	0,850%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,150%	08/03/2012	08/03/2017	EUR	19.761.423	19.761.423	-	0,849%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,000%	03/05/2012	03/05/2017	EUR	17.746.155	17.746.155	-	0,866%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	0,000%	14/06/2012	14/06/2017	EUR	7.558.020	7.558.020	92,34	0,901%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	2,250%	23/02/2012	23/02/2017	EUR	12.249.984	12.249.984	-	0,849%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Bank AG/London	0,429%	30/10/2012	30/10/2017	EUR	64.824.000	64.824.000	86,36	0,842%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	0,304%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	13.316.700	13.316.700	9,68	0,145%	AAA	Consumer Finance	99,950	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	0,118%	31/08/2012	31/08/2017	EUR	62.854.000	62.854.000	-3,24	0,016%	AAA	Consumer Finance	99,970	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	1,875%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	131.293.000	131.293.000	-	0,093%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	1,750%	07/03/2012	07/04/2017	EUR	13.143.300	13.143.300	-	0,861%	A+	Consumer Finance	100,250	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	1,800%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	33.526.750	33.526.750	-	0,151%	AAA	Consumer Finance	99,850	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	0,950%	27/09/2012	27/09/2017	EUR	25.792.000	25.792.000	-	0,144%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	1,500%	22/08/2012	22/09/2017	EUR	12.467.300	12.467.300	-	0,888%	A+	Consumer Finance	101,100	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,232%	12/01/2012	12/01/2017	EUR	128.340.000	128.340.000	29,01	0,268%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	0,536%	20/11/2012	20/11/2017	EUR	12.806.000	12.806.000	39,35	0,441%	-	Consumer Finance	99,900	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,300%	11/07/2012	11/07/2017	EUR	24.507.200	24.507.200	-	0,142%	-	Consumer Finance	99,960	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	0,282%	11/07/2012	11/07/2017	EUR	18.380.400	18.380.400	7,03	0,048%	-	Consumer Finance	99,990	DE

Deutsche Hypothekenbank AG	1,600%	25/10/2012	25/10/2017	EUR	12.963.500	12.963.500	-	0,528%	-	Consumer Finance	99,880	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,830%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	26.633.400	26.633.400	-	0,156%	-	Consumer Finance	99,965	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,000%	24/08/2012	24/08/2017	EUR	31.339.500	31.339.500	-	0,127%	-	Consumer Finance	99,700	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,625%	13/04/2012	13/04/2017	EUR	65.421.000	65.421.000	-	0,110%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	2,600%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	13.152.700	13.152.700	-	0,442%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Kreditbank AG	1,000%	24/10/2012	24/10/2017	EUR	129.542.000	129.542.000	-	0,093%	-	Banks	99,900	DE
Deutsche Kreditbank AG	0,039%	14/12/2012	14/12/2017	EUR	26.336.200	26.336.200	9,31	0,141%	-	Banks	99,950	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,625%	04/07/2012	04/07/2017	EUR	627.145.000	627.145.000	-	0,004%	AA+	Banks	99,658	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	0,000%	22/06/2012	22/06/2017	EUR	12.562.200	12.562.200	54,95	0,527%	AA+	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	3,000%	20/02/2012	20/02/2017	EUR	19.858.650	19.858.650	-	1,547%	-	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	0,489%	22/06/2012	22/06/2017	EUR	138.184.200	138.184.200	20,32	0,251%	AA+	Banks	100,000	DE
Deutsche Post Finance BV	1,875%	25/06/2012	27/06/2017	EUR	937.335.000	937.335.000	-	0,281%	NR	Transportation & Logistics	99,467	NL
DGH Finance II GmbH	6,250%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	325.040.000	325.040.000	-	2,492%	-	Real Estate	99,000	DE
DNB Bank ASA	2,750%	21/03/2012	21/03/2017	EUR	659.885.000	659.885.000	-	0,230%	A+	Banks	99,963	NO
DNB Bank ASA	2,250%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	99.231.000	99.231.000	40,82	0,386%	-	Banks	100,000	NO
DNB Boligkreditt AS	1,875%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	66.689.000	66.689.000	-	0,227%	AAA	Banks	99,408	NO
DNB Boligkreditt AS	0,191%	21/12/2012	21/01/2018	EUR	26.338.000	26.338.000	3,82	0,016%	AAA	Banks	100,000	NO
Duesseldorfer Hypothekenbank AG	0,359%	11/12/2012	11/12/2017	EUR	64.996.000	64.996.000	3,29	0,081%	-	Consumer Finance	99,960	DE
DVB Bank SE	2,500%	30/08/2012	30/08/2017	EUR	625.070.000	625.070.000	-	0,520%	A+	Commercial Finance	100,000	DE
DVB Bank SE	2,520%	30/05/2012	30/05/2017	EUR	24.812.400	24.812.400	-	0,710%	A+	Commercial Finance	100,000	DE
DVB Bank SE	1,740%	14/05/2012	15/06/2017	EUR	25.692.000	25.692.000	-	0,242%	-	Commercial Finance	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,486%	20/06/2012	20/06/2017	EUR	380.769.000	380.769.000	24,74	0,225%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,329%	12/07/2012	12/07/2017	EUR	365.931.000	365.931.000	16,50	0,213%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,205%	20/09/2012	20/09/2017	EUR	388.260.000	388.260.000	-	0,035%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,750%	24/08/2012	29/09/2017	EUR	62.679.000	62.679.000	-	0,722%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,378%	31/07/2012	31/07/2017	EUR	123.058.000	123.058.000	23,40	0,282%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,450%	25/09/2012	25/09/2017	EUR	259.040.000	259.040.000	-	0,321%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,875%	19/12/2012	19/12/2017	EUR	99.335.250	99.335.250	-	0,134%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,875%	24/01/2012	24/01/2017	EUR	65.110.000	65.110.000	-	0,394%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,375%	21/08/2012	21/08/2017	EUR	124.782.000	124.782.000	-	0,363%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,407%	02/08/2012	02/08/2017	EUR	12.164.000	12.164.000	19,14	0,169%	AA+	Banks	100,000	DE

DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,400%	04/06/2012	23/06/2017	EUR	62.382.000	62.382.000	-	2,177%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,341%	09/05/2012	09/05/2017	EUR	12.951.100	12.951.100	34,34	0,391%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	4,310%	26/11/2012	27/12/2017	EUR	64.797.500	64.797.500	-	0,811%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,850%	06/09/2012	25/09/2017	EUR	63.157.000	63.157.000	-	0,356%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,375%	24/08/2012	29/09/2017	EUR	62.679.000	62.679.000	-	0,400%	-	Banks	100,450	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,250%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	65.763.500	65.763.500	-	0,406%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,249%	03/08/2012	03/08/2017	EUR	30.927.250	30.927.250	18,42	0,353%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,350%	24/08/2012	25/09/2017	EUR	31.339.500	31.339.500	-	0,301%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,300%	21/08/2012	25/09/2017	EUR	62.391.000	62.391.000	-	0,258%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	4,400%	23/02/2012	23/03/2017	EUR	66.576.000	66.576.000	-	0,441%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,750%	16/02/2012	23/03/2017	EUR	65.519.000	65.519.000	-	0,048%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,526%	25/06/2012	23/06/2017	EUR	62.489.000	62.489.000	5,39	0,032%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,209%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	30.960.250	30.960.250	18,00	0,349%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,550%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	92.880.750	92.880.750	-	0,374%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	4,020%	14/03/2012	14/03/2017	EUR	6.508.850	6.508.850	-	0,772%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,790%	24/04/2012	24/04/2017	EUR	19.796.700	19.796.700	-	0,448%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,418%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	33.526.750	33.526.750	31,59	0,364%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,487%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	199.750.500	199.750.500	29,17	0,270%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,213%	04/07/2012	04/07/2017	EUR	31.357.250	31.357.250	18,08	0,350%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,564%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	61.409.000	61.409.000	15,92	0,328%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,060%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	12.281.800	12.281.800	45,87	0,437%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,009%	05/09/2012	05/09/2017	EUR	126.046.000	126.046.000	14,63	0,315%	-	Banks	102,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,200%	27/06/2012	27/06/2017	EUR	12.474.900	12.474.900	27,13	0,440%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,085%	07/12/2012	27/12/2017	EUR	64.700.500	64.700.500	23,82	0,216%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,900%	26/11/2012	27/12/2017	EUR	64.797.500	64.797.500	-	0,267%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,650%	13/12/2012	27/12/2017	EUR	65.347.500	65.347.500	6,50	0,043%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	4,636%	24/08/2012	25/09/2017	EUR	62.679.000	62.679.000	44,07	0,419%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,850%	20/03/2012	23/03/2017	EUR	66.154.000	66.154.000	-	1,245%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,760%	15/03/2012	23/03/2017	EUR	65.506.500	65.506.500	-	0,205%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	3,100%	06/09/2012	25/09/2017	EUR	63.157.000	63.157.000	-	0,335%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,201%	18/12/2012	18/12/2017	EUR	66.149.500	66.149.500	26,20	0,310%	-	Banks	100,000	DE

DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,498%	27/09/2012	27/09/2017	EUR	128.960.000	128.960.000	23,74	0,285%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,295%	22/08/2012	22/08/2017	EUR	62.336.500	62.336.500	3,73	0,085%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,486%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	33.077.000	33.077.000	38,76	0,366%	-	Banks	100,000	DE
DZ Privatbank SA	0,571%	11/05/2012	11/05/2017	EUR	64.708.500	64.708.500	29,92	0,277%	-	Banks	100,000	LU
DZ Privatbank SA	1,700%	11/05/2012	11/05/2017	EUR	6.470.850	6.470.850	-	0,538%	-	Banks	99,929	LU
DZ Privatbank SA	1,200%	23/11/2012	23/11/2017	EUR	64.930.500	64.930.500	-	0,489%	-	Banks	99,918	LU
DZ Privatbank SA	0,488%	23/11/2012	23/11/2017	EUR	32.465.250	32.465.250	36,59	0,344%	-	Banks	100,000	LU
EBS Mortgage Finance	1,929%	19/12/2012	19/12/2017	EUR	397.341.000	397.341.000	34,53	0,271%	-	Consumer Finance	98,250	IE
EDP Finance BV	5,750%	21/09/2012	21/09/2017	EUR	975.187.500	975.187.500	-	0,818%	BB+	Utilities	99,472	NL
EE Finance PLC	3,500%	06/02/2012	06/02/2017	EUR	656.410.000	656.410.000	-	0,538%	BBB	Wireless Telecommunications Services	99,617	GB
Eika Boligkreditt AS	1,250%	06/11/2012	06/11/2017	EUR	1.281.480.000	1.281.480.000	-	0,098%	-	Consumer Finance	99,687	NO
Eika Boligkreditt AS	2,250%	25/01/2012	25/01/2017	EUR	652.390.000	652.390.000	-	0,037%	-	Consumer Finance	99,524	NO
Emil Banca Credito Cooperativo SC	3,850%	16/04/2012	16/04/2017	EUR	26.183.800	26.183.800	-	1,429%	-	Banks	100,000	IT
Enagas Financiaciones SAU	4,250%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	610.442.040	978.900.000	-	0,379%	BBB+	Utilities	99,801	ES
Erste Abwicklungsanstalt	0,175%	21/12/2012	15/12/2017	EUR	26.338.000	26.338.000	-	0,255%	AA-	Winding Up Agencies	97,010	DE
Erste Group Bank AG	3,375%	28/03/2012	28/03/2017	EUR	665.315.000	665.315.000	-	0,626%	BBB+	Banks	99,778	AT
Erste Group Bank AG	3,150%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	11.063.983	11.063.983	-	0,888%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,500%	19/10/2012	19/10/2017	EUR	10.419.920	10.419.920	92,09	0,899%	-	Banks	98,600	AT
Erste Group Bank AG	2,500%	18/05/2012	18/05/2017	EUR	9.166.320	9.166.320	95,60	0,934%	-	Banks	99,750	AT
Erste Group Bank AG	2,450%	18/05/2012	18/05/2017	EUR	13.224.963	13.224.963	-	0,875%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,500%	15/03/2012	15/03/2017	EUR	5.240.520	5.240.520	-	0,922%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,200%	19/09/2012	20/10/2017	EUR	3.414.904	3.414.904	-	0,823%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,700%	30/05/2012	30/05/2017	EUR	6.451.224	6.451.224	-	0,916%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,000%	07/05/2012	07/05/2017	EUR	9.795.750	9.795.750	-	0,901%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,500%	11/04/2012	11/04/2017	EUR	198.089.350	198.089.350	57,15	0,550%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,200%	25/07/2012	31/07/2017	EUR	1.697.626	1.697.626	-	1,007%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,750%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	10.470.173	10.470.173	88,71	0,865%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,350%	27/06/2012	27/06/2017	EUR	23.702.310	23.702.310	-	0,861%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,881%	26/07/2012	26/07/2017	EUR	4.297.475	4.297.475	90,60	0,884%	-	Banks	100,000	AT

Erste Group Bank AG	2,600%	22/06/2012	22/06/2017	EUR	1.742.377	1.742.377	-	0,979%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	5,000%	20/06/2012	20/06/2017	EUR	5.076.920	5.076.920	-	4,999%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,500%	25/07/2012	25/07/2017	EUR	2.556.140	2.556.140	-	0,970%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,830%	24/07/2012	24/07/2017	EUR	1.807.890	1.807.890	-	0,993%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,986%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	13.262.700	13.262.700	83,42	0,812%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,250%	23/04/2012	23/04/2017	EUR	9.195.480	9.195.480	-	0,906%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,850%	26/09/2012	20/10/2017	EUR	4.115.968	4.115.968	-	1,052%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,500%	14/02/2012	14/02/2017	EUR	13.118	13.118	53,70	0,515%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,600%	02/05/2012	02/05/2017	EUR	474.012	474.012	-	0,393%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,300%	18/07/2012	18/07/2017	EUR	3.153.486	3.153.486	-	0,953%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,050%	18/07/2012	18/07/2017	EUR	1.590.848	1.590.848	-	0,976%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,150%	26/06/2012	26/06/2017	EUR	2.498.900	2.498.900	95,83	0,936%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,000%	24/04/2012	24/04/2017	EUR	1.319.780	1.319.780	-	0,983%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,000%	21/05/2012	22/05/2017	EUR	5.496.088	5.496.088	90,61	0,884%	-	Banks	99,500	AT
Erste Group Bank AG	2,700%	09/05/2012	09/05/2017	EUR	1.165.599	1.165.599	-	0,985%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,500%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	807.132	807.132	96,32	0,941%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,790%	26/07/2012	26/07/2017	EUR	4.297.475	4.297.475	-	0,955%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,300%	18/07/2012	18/07/2017	EUR	1.249.865	1.249.865	-	0,993%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,800%	09/03/2012	09/03/2017	EUR	10.494.240	10.494.240	-	0,871%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	4,000%	11/04/2012	20/04/2017	EUR	1.574.220	1.574.220	-	0,628%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	4,000%	11/04/2012	25/04/2017	EUR	393.555	393.555	-	0,630%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,600%	29/10/2012	29/10/2017	EUR	9.674.400	9.674.400	-	0,962%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,700%	28/11/2012	28/11/2017	EUR	3.882.390	3.882.390	-	0,992%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,500%	05/09/2012	05/09/2017	EUR	1.260.460	1.260.460	99,55	0,974%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,200%	07/11/2012	07/11/2017	EUR	1.745.842	1.745.842	100,07	0,979%	-	Banks	100,000	AT
ERVIA	3,625%	04/12/2012	04/12/2017	EUR	654.620.000	654.620.000	-	0,428%	A	Government Agencies	99,829	IE
ESB Finance Ltd	6,250%	11/09/2012	11/09/2017	EUR	385.881.000	771.762.000	-	0,401%	A-	Utilities	100,000	IE
Fagron	4,750%	02/07/2012	02/07/2017	EUR	283.317.750	283.317.750	-	2,762%	-	Pharmaceuticals	101,875	BE
FCE Bank PLC	2,875%	03/10/2012	03/10/2017	EUR	645.410.000	645.410.000	-	0,607%	-	Automobiles Manufacturing	99,899	GB
Fiat Chrysler Finance Europe	7,000%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	1.127.329.500	1.127.329.500	-	2,339%	BB-	Automobiles Manufacturing	100,000	LU
Financiere Agache SA	3,179%	25/10/2012	25/10/2017	EUR	356.496.250	356.496.250	-	0,690%	-	Financial Services	100,000	FR

Finmeccanica SpA	4,375%	05/12/2012	05/12/2017	EUR	681.948.124	785.154.000	-	1,247%	BB+	Aerospace & Defense	99,421	IT
FMS Wertmanagement AoeR	1,750%	18/01/2012	18/01/2017	EUR	128.501.000	128.501.000	-	0,107%	AAA	Winding Up Agencies	100,000	DE
Fonciere de Paris SIIC	4,250%	18/07/2012	18/07/2017	EUR	61.328.000	61.328.000	-	3,178%	-	Real Estate	100,000	FR
Free and Hanseatic City of Hamburg	1,750%	02/02/2012	02/02/2017	EUR	263.028.000	263.028.000	-	0,025%	-	Government Local	100,000	DE
Free and Hanseatic City of Hamburg	1,000%	12/12/2012	12/12/2017	EUR	65.440.500	65.440.500	-	0,162%	-	Government Local	100,614	DE
G4S International Finance PLC	2,875%	02/05/2012	02/05/2017	EUR	790.020.000	790.020.000	-	0,616%	BBB-	Consumer Services	99,336	GB
GDF Suez	1,500%	20/07/2012	20/07/2017	EUR	912.975.000	912.975.000	-	0,195%	A	Power Generation	99,704	FR
Golfino AG	7,250%	05/04/2012	04/04/2017	EUR	15.675.600	15.675.600	-	6,006%	-	Apparel & Textile Products	100,000	DE
HAHN-Immobilien-Beteiligungs AG	6,250%	01/10/2012	01/10/2017	EUR	25.793.800	25.793.800	-	3,815%	-	Real Estate	100,000	DE
Halloren Schokoladenfabrik AG	6,250%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	12.651.100	12.651.100	-	0,896%	-	Food & Beverage	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,375%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	61.920.500	61.920.500	-	0,142%	-	Banks	99,850	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,850%	15/02/2012	15/02/2017	EUR	28.734.200	28.734.200	39,55	0,444%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,400%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	18.604.224	61.497.500	-	0,228%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,750%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	16.425.982	61.497.500	-	0,225%	-	Banks	100,150	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,700%	10/04/2012	10/04/2017	EUR	24.216.685	26.180.200	41,52	0,463%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,550%	12/06/2012	12/06/2017	EUR	19.975.680	19.975.680	41,90	0,467%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	2,250%	02/05/2012	02/05/2017	EUR	12.733.806	65.835.000	-	0,566%	-	Banks	100,500	DE
Hamburger Sparkasse AG	2,250%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	20.436.376	66.650.500	-	0,536%	-	Banks	100,250	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,750%	13/03/2012	13/03/2017	EUR	13.110.500	13.110.500	43,93	0,487%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	2,400%	02/01/2012	02/01/2017	EUR	23.357.778	64.660.000	-	0,503%	-	Banks	100,050	DE
Hamburger Sparkasse AG	3,000%	02/01/2012	02/01/2017	EUR	9.361.475	64.660.000	-	0,560%	-	Banks	100,050	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,750%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	13.316.700	13.316.700	-	0,220%	-	Banks	99,820	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,250%	17/11/2012	17/11/2017	EUR	24.296.205	64.011.500	-	0,255%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,250%	17/11/2012	17/11/2017	EUR	10.450.517	64.011.500	-	0,253%	-	Banks	100,000	DE
Heathrow Funding Ltd	4,375%	25/01/2012	25/01/2017	EUR	913.346.000	913.346.000	-	0,401%	A-	Industrial Other	99,850	GB
Hellenic Republic Government Bond	1,542%	07/02/2012	07/02/2017	EUR	6.591.728	6.591.728	-	21,817%	-	Sovereigns	100,000	GR
HOCHTIEF AG	5,500%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	663.135.000	663.135.000	-	1,138%	-	Industrial Other	99,468	DE
Homann Holzwerkstoffe GmbH	7,000%	14/12/2012	14/12/2017	EUR	131.681.000	131.681.000	-	7,585%	-	Home & Office Products Manufacturing	100,000	DE
HSBC Bank PLC	2,100%	20/02/2012	07/02/2017	EUR	5.295.640	5.295.640	85,74	0,835%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	1,900%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	4.294.982	4.294.982	82,54	0,803%	-	Banks	100,000	GB

HSBC Bank PLC	1,900%	03/01/2012	03/01/2017	EUR	2.075.135	2.075.135	87,21	0,850%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	2,000%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	3.945.810	3.945.810	86,77	0,846%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	2,318%	15/03/2012	15/03/2017	EUR	314.431.200	314.431.200	-	0,344%	AA-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	2,200%	02/03/2012	02/03/2017	EUR	146.638.770	146.638.770	69,73	0,675%	AA-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	2,000%	21/03/2012	21/03/2017	EUR	7.258.735	7.258.735	83,47	0,813%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	0,381%	18/04/2012	18/04/2017	EUR	3.331.362	3.331.362	81,22	0,790%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	0,987%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	2.929.674	2.929.674	82,87	0,807%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	2,150%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	15.296.590	15.296.590	81,37	0,792%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	2,100%	13/03/2012	13/03/2017	EUR	5.244.200	5.244.200	85,21	0,830%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	2,200%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	7.324.185	7.324.185	83,79	0,816%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Bank PLC	1,900%	07/02/2012	07/02/2017	EUR	3.843.523	3.843.523	84,05	0,819%	-	Banks	100,000	GB
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG	0,000%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	619.205.000	619.205.000	54,50	0,471%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,875%	05/04/2012	05/04/2017	EUR	653.150.000	653.150.000	-	0,019%	-	Banks	99,891	DE
HSH Nordbank AG	0,428%	27/07/2012	27/07/2017	EUR	24.712.800	24.712.800	67,82	1,109%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,150%	14/08/2012	14/08/2017	EUR	30.834.500	30.834.500	-	0,643%	-	Banks	99,810	DE
HSH Nordbank AG	2,000%	14/09/2012	14/09/2017	EUR	258.477.790	262.414.000	-	0,515%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,000%	10/10/2012	10/10/2017	EUR	2.577.860	2.577.860	115,30	1,131%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,000%	18/07/2012	18/07/2017	EUR	4.292.960	4.292.960	66,51	0,643%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,210%	16/07/2012	17/07/2017	EUR	6.130.250	6.130.250	-	0,701%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,281%	24/07/2012	24/07/2017	EUR	16.873.640	16.873.640	55,63	0,534%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,000%	08/05/2012	08/05/2017	EUR	9.107.000	9.107.000	61,27	0,591%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,145%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	13.316.700	13.316.700	-	0,282%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,169%	28/09/2012	28/09/2017	EUR	6.437.850	6.437.850	53,03	0,578%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,500%	09/05/2012	09/05/2017	EUR	1.942.665	1.942.665	103,72	1,182%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,150%	08/06/2012	08/06/2017	EUR	14.990.160	14.990.160	-	0,646%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,250%	31/07/2012	31/07/2017	EUR	20.356.254	20.919.860	-	0,654%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,065%	16/03/2012	16/03/2017	EUR	65.842.500	65.842.500	26,46	0,434%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,100%	23/05/2012	23/05/2017	EUR	12.560.400	12.560.400	-	0,646%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,910%	05/04/2012	05/04/2017	EUR	13.063.000	13.063.000	-	0,273%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,930%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	6.726.100	6.726.100	-	0,666%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,680%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	6.726.100	6.726.100	54,34	0,591%	-	Banks	100,000	DE

HSN Nordbank AG	2,160%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	12.299.500	12.299.500	-	0,676%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	0,737%	28/08/2012	28/08/2017	EUR	2.514.200	2.514.200	63,46	0,613%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,148%	31/07/2012	31/07/2017	EUR	6.152.900	6.152.900	51,39	0,562%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	2,140%	07/08/2012	07/08/2017	EUR	24.836.600	24.836.600	-	0,648%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,276%	05/09/2012	05/09/2017	EUR	12.604.600	12.604.600	58,26	0,561%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	2,000%	08/05/2012	08/05/2017	EUR	18.897.025	19.515.000	-	0,621%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,079%	18/05/2012	18/05/2017	EUR	12.731.000	12.731.000	47,61	0,524%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	2,750%	08/02/2012	08/02/2017	EUR	2.654.520	2.654.520	-	0,693%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,500%	19/09/2012	19/09/2017	EUR	9.148.230	9.148.230	-	0,699%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,870%	17/12/2012	17/12/2017	EUR	19.734.900	19.734.900	-	0,724%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,500%	14/08/2012	14/08/2017	EUR	42.708.249	43.168.300	-	0,610%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	2,100%	26/10/2012	26/10/2017	EUR	6.465.000	6.465.000	-	0,750%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,500%	28/11/2012	28/11/2017	EUR	12.941.300	12.941.300	-	0,721%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,550%	31/08/2012	31/08/2017	EUR	1.257.080	1.257.080	71,49	0,693%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	1,600%	09/10/2012	09/10/2017	EUR	42.486.180	42.486.180	-	0,645%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	0,750%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	25.939.400	25.939.400	47,53	0,523%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	2,120%	21/08/2012	21/08/2017	EUR	24.956.400	24.956.400	-	0,655%	-	Banks	100,000	DE
HSN Nordbank AG	2,120%	29/08/2012	29/08/2017	EUR	12.527.100	12.527.100	-	0,689%	-	Banks	100,000	DE
Huhtamaki OYJ	3,500%	05/06/2012	05/06/2017	EUR	155.480.000	155.480.000	-	0,988%	-	Containers & Packaging	99,572	FI
HYPO NOE Landesbank AG	2,500%	01/02/2012	01/02/2017	EUR	13.184.000	13.184.000	-	0,545%	-	Consumer Finance	100,850	AT
Hypo Tirol Bank AG	2,500%	10/05/2012	10/05/2017	EUR	19.444.200	19.444.200	-	0,361%	-	Consumer Finance	100,100	AT
Iberdrola International BV	4,500%	21/09/2012	21/09/2017	EUR	482.782.825	1.300.250.000	-	0,373%	BBB	Utilities	99,536	NL
IBL Istituto Bancario Del Lavoro SpA	5,500%	21/05/2012	21/05/2017	EUR	15.337.920	15.337.920	-	4,187%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	4,800%	02/07/2012	02/07/2017	EUR	52.653.030	52.653.030	-	0,783%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	4,250%	28/12/2012	28/12/2017	EUR	72.721.550	72.721.550	-	1,127%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	4,350%	28/12/2012	28/12/2017	EUR	26.444.200	26.444.200	-	1,825%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	5,570%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	9.727.275	9.727.275	-	1,032%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	5,000%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	125.692.600	125.692.600	-	0,492%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	5,000%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	284.462.200	284.462.200	-	2,109%	-	Consumer Finance	100,000	IT
IKB Deutsche Industriebank AG	3,500%	04/07/2012	04/07/2017	EUR	12.542.900	12.542.900	-	0,658%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Immigon Portfolioabbau AG	1,432%	13/07/2012	13/07/2017	EUR	3.669.480	3.669.480	1.229,51	12,273%	-	Banks	100,000	AT

Immigon Portfolioabbau AG	0,000%	10/04/2012	10/04/2017	EUR	3.927.030	3.927.030	2,34	0,001%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	3,350%	13/02/2012	13/02/2017	EUR	3.962.610	3.962.610	-	11,498%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	3,350%	08/05/2012	08/05/2017	EUR	3.252.500	3.252.500	-	12,238%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	3,000%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	3.978.810	3.978.810	-	11,879%	-	Banks	100,000	AT
IMMOFINANZ AG	5,250%	03/07/2012	03/07/2017	EUR	126.116.000	126.116.000	-	2,281%	-	Real Estate	101,400	AT
ING Bank NV	4,250%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	1.584.700.000	1.584.700.000	-	0,268%	A	Banks	99,757	NL
ING Bank NV	1,285%	27/09/2012	27/09/2017	EUR	1.289.600.000	1.289.600.000	22,19	0,200%	A	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	0,888%	27/11/2012	27/11/2017	EUR	323.465.000	323.465.000	28,04	0,258%	A	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	2,250%	13/04/2012	13/04/2017	EUR	65.421.000	65.421.000	45,28	0,431%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	2,500%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	33.656.250	33.656.250	48,56	0,464%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	0,696%	20/09/2012	20/09/2017	EUR	25.884.000	25.884.000	39,99	0,448%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	2,300%	20/07/2012	20/07/2017	EUR	18.259.500	18.259.500	-	0,582%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	2,000%	24/08/2012	24/08/2017	EUR	18.803.700	18.803.700	-	0,602%	-	Banks	100,000	NL
ING-DiBa AG	0,236%	16/03/2012	16/03/2017	EUR	32.921.250	32.921.250	10,21	0,080%	-	Banks	99,510	DE
ING-DiBa AG	0,281%	26/04/2012	26/04/2017	EUR	33.088.000	33.088.000	2,54	0,003%	-	Banks	99,926	DE
Instituto de Credito Oficial	4,625%	25/01/2012	31/01/2017	EUR	4.292.726.200	4.371.013.000	-	0,187%	BBB	Government Agencies	99,465	ES
Intesa Sanpaolo SpA	4,000%	09/11/2012	09/11/2017	EUR	2.176.602.593	2.176.602.593	-	0,800%	BBB-	Banks	99,964	IT
Intesa Sanpaolo SpA	5,000%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	1.345.220.000	1.345.220.000	-	0,719%	BBB-	Banks	99,254	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,000%	25/10/2012	25/10/2017	EUR	586.258.731	586.258.731	123,71	1,215%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,800%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	652.600.000	652.600.000	-	1,266%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,000%	05/11/2012	05/11/2017	EUR	438.092.234	438.092.234	-	1,147%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,000%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	300.757.236	300.757.236	117,01	1,148%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,800%	04/10/2012	04/10/2017	EUR	194.779.221	194.779.221	-	1,126%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,800%	03/10/2012	03/10/2017	EUR	332.965.728	332.965.728	-	1,208%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	3,000%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	162.841.835	162.841.835	114,10	1,119%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	3,440%	02/03/2012	02/03/2017	EUR	180.291.707	180.291.707	100,75	0,985%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	5,150%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	148.158.547	148.158.547	-	1,424%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,200%	04/05/2012	04/05/2017	EUR	651.792	651.792	110,63	1,084%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,385%	06/02/2012	06/02/2017	EUR	328.203.687	328.203.687	85,73	0,835%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	3,750%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	137.022.764	137.022.764	104,10	1,210%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	4,320%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	49.975.328	49.975.328	137,24	1,350%	-	Banks	100,000	IT

Intesa Sanpaolo SpA	3,080%	05/06/2012	05/06/2017	EUR	1.167.966	1.167.966	113,36	1,112%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,279%	10/12/2012	10/12/2017	EUR	30.661.164	30.661.164	192,18	1,970%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,520%	04/12/2012	04/12/2017	EUR	22.814.816	22.814.816	189,52	1,873%	-	Banks	100,000	IT
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4,750%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	19.578.519.054	19.578.519.054	-	0,126%	-	Sovereigns	96,400	IT
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	3,500%	01/11/2012	01/11/2017	EUR	22.428.761.256	22.428.761.256	-	0,177%	-	Sovereigns	98,800	IT
Jacob Stauder GmbH & Co KG	7,500%	23/11/2012	23/11/2017	EUR	12.986.100	12.986.100	-	3,851%	-	Food & Beverage	100,000	DE
KBC Bank NV	1,125%	11/12/2012	11/12/2017	EUR	1.624.900.000	1.624.900.000	-	0,074%	-	Banks	99,638	BE
KBC IFIMA SA	4,500%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	1.333.780.000	1.333.780.000	-	0,319%	A	Banks	99,770	LU
KBC IFIMA SA	1,500%	23/11/2012	23/11/2017	EUR	32.465.250	32.465.250	58,18	0,560%	A	Banks	100,000	LU
Kreissparkasse Goeppingen	1,750%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	13.337.800	13.337.800	-	0,272%	-	Banks	99,830	DE
Kreissparkasse Koeln	0,210%	27/12/2012	15/12/2017	EUR	109.646.320	109.646.320	-	0,203%	-	Banks	97,010	DE
Kreissparkasse Koeln	1,000%	23/08/2012	23/08/2017	EUR	25.153.400	25.153.400	-	0,514%	-	Banks	99,700	DE
Kreissparkasse Koeln	1,020%	05/11/2012	06/11/2017	EUR	38.337.000	38.337.000	-	0,266%	-	Banks	100,000	DE
Kreissparkasse Saarpfalz	1,300%	10/02/2012	01/03/2017	EUR	6.597.100	6.597.100	-	0,599%	-	Banks	98,790	DE
Kreissparkasse Wesermuende-Hadeln	1,250%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	6.149.750	6.149.750	-	0,728%	-	Banks	100,240	DE
KTM AG	4,375%	24/04/2012	24/04/2017	EUR	112.181.300	112.181.300	-	1,507%	-	Automobiles Manufacturing	101,389	AT
Lafarge SA	5,250%	15/03/2012	15/03/2017	EUR	65.506.500	65.506.500	-	1,633%	-	Construction Materials Manufacturing	100,000	FR
Lagardere SCA	4,125%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	648.485.000	648.485.000	-	1,336%	-	Publishing & Broadcasting	99,307	FR
Landesbank Berlin AG	0,699%	09/01/2012	09/01/2017	EUR	127.377.000	127.377.000	20,94	0,378%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,831%	17/01/2012	17/01/2017	EUR	190.993.500	190.993.500	39,84	0,376%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	26/01/2012	26/01/2017	EUR	131.484.000	131.484.000	45,27	0,431%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,730%	05/09/2012	11/10/2017	EUR	6.302.300	6.302.300	-	1,109%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,250%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	45.747.800	65.354.000	-	0,512%	-	Banks	99,810	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	31/07/2012	31/07/2017	EUR	123.058.000	123.058.000	-	0,454%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,000%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	129.697.000	129.697.000	-	0,457%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,050%	02/10/2012	02/10/2017	EUR	129.415.000	129.415.000	-	0,453%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,300%	19/01/2012	19/01/2017	EUR	2.586.300	2.586.300	-	0,636%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	20/06/2012	20/06/2017	EUR	63.461.500	63.461.500	-	0,165%	-	Banks	100,500	DE
Landesbank Berlin AG	1,800%	04/04/2012	04/04/2017	EUR	131.356.000	131.356.000	-	0,457%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,700%	30/05/2012	30/05/2017	EUR	124.062.000	124.062.000	-	0,457%	-	Banks	100,000	DE

Landesbank Berlin AG	1,250%	30/05/2012	30/05/2017	EUR	124.062.000	124.062.000	45,48	0,433%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,850%	02/05/2012	02/05/2017	EUR	3.950.100	3.950.100	-	0,611%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	4.023.210	4.023.210	60,71	0,585%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,800%	06/03/2012	06/03/2017	EUR	131.146.000	131.146.000	-	0,455%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,404%	23/11/2012	23/11/2017	EUR	64.930.500	64.930.500	35,46	0,403%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,200%	04/09/2012	04/09/2017	EUR	3.768.300	3.768.300	-	0,603%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,000%	04/09/2012	04/09/2017	EUR	2.512.200	2.512.200	62,13	0,599%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,330%	13/01/2012	16/12/2016	EUR	63.388.000	63.388.000	-	0,495%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,050%	09/02/2012	09/02/2017	EUR	132.966.000	132.966.000	-	0,461%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,200%	23/11/2012	23/11/2017	EUR	64.930.500	64.930.500	-	0,497%	-	Banks	99,900	DE
Landesbank Berlin AG	0,875%	04/12/2012	04/12/2017	EUR	16.365.500	19.638.600	-	0,224%	-	Banks	100,200	DE
Landesbank Berlin AG	1,230%	07/12/2012	07/12/2017	EUR	64.700.500	64.700.500	-	0,500%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,950%	04/09/2012	04/09/2017	EUR	12.561.000	12.561.000	-	0,222%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	2,100%	19/01/2012	19/01/2017	EUR	3.879.450	3.879.450	-	0,613%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,250%	03/07/2012	03/07/2017	EUR	126.116.000	126.116.000	45,70	0,435%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,600%	03/07/2012	03/07/2017	EUR	126.116.000	126.116.000	-	0,455%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	133.301.000	133.301.000	46,29	0,441%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,750%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	129.697.000	129.697.000	38,25	0,361%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,750%	02/10/2012	02/10/2017	EUR	2.588.300	2.588.300	61,36	0,592%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,375%	28/09/2012	16/10/2017	EUR	96.567.750	96.567.750	-	0,477%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	0,900%	04/10/2012	04/10/2017	EUR	13.018.000	13.018.000	-	0,225%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,500%	02/05/2012	02/05/2017	EUR	3.950.100	3.950.100	61,07	0,589%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,481%	20/04/2012	20/04/2017	EUR	6.605.950	6.605.950	52,68	0,505%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,000%	31/07/2012	31/07/2017	EUR	307.645.000	307.645.000	3,95	0,017%	-	Banks	99,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,250%	14/11/2012	14/11/2017	EUR	318.647.500	318.647.500	-	0,394%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,000%	04/04/2012	04/04/2017	EUR	65.678.000	65.678.000	41,05	0,458%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	11/01/2012	11/01/2017	EUR	63.490.500	63.490.500	40,47	0,453%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,600%	06/06/2012	06/06/2017	EUR	62.795.500	62.795.500	-	0,386%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,250%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	326.770.000	326.770.000	-	0,215%	-	Banks	99,910	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,000%	02/03/2012	02/03/2017	EUR	66.053.500	66.053.500	-	0,373%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,888%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	40.387.500	40.387.500	45,17	0,430%	-	Banks	100,000	DE

Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,200%	07/03/2012	07/03/2017	EUR	65.716.500	65.716.500	41,44	0,462%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,150%	12/04/2012	12/04/2017	EUR	65.885.500	65.885.500	52,47	0,503%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,591%	01/02/2012	01/02/2017	EUR	263.680.000	263.680.000	25,69	0,426%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,481%	26/07/2012	26/07/2017	EUR	122.785.000	122.785.000	19,86	0,368%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,479%	30/10/2012	30/10/2017	EUR	129.648.000	129.648.000	40,26	0,381%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,520%	06/06/2012	06/06/2017	EUR	62.795.500	62.795.500	39,30	0,441%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,125%	04/04/2012	04/04/2017	EUR	328.390.000	328.390.000	-	0,232%	-	Banks	99,670	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,250%	02/02/2012	02/02/2017	EUR	263.028.000	263.028.000	-	0,315%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,608%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	13.316.700	13.316.700	33,92	0,508%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,770%	10/01/2012	10/01/2017	EUR	31.945.000	31.945.000	-	0,411%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,300%	08/02/2012	08/02/2017	EUR	66.363.000	66.363.000	40,77	0,456%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,089%	26/09/2012	26/09/2017	EUR	321.560.000	321.560.000	0,27	0,051%	-	Banks	100,100	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,200%	07/03/2012	07/03/2017	EUR	4.987.882	4.987.882	66,59	0,773%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,400%	11/01/2012	11/01/2017	EUR	63.490.500	63.490.500	71,14	0,818%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,749%	06/06/2012	06/06/2017	EUR	6.279.550	6.279.550	47,31	0,521%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,400%	27/06/2012	27/06/2017	EUR	62.374.500	62.374.500	-	0,386%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,800%	09/05/2012	09/05/2017	EUR	64.755.500	64.755.500	-	0,385%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,600%	23/05/2012	23/05/2017	EUR	62.802.000	62.802.000	-	0,382%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,600%	03/05/2012	03/05/2017	EUR	65.726.500	65.726.500	38,82	0,436%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,625%	04/04/2012	04/04/2017	EUR	262.712.000	262.712.000	-	0,042%	-	Banks	99,820	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,631%	11/04/2012	11/04/2017	EUR	327.962.500	327.962.500	22,89	0,277%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,505%	12/04/2012	12/04/2017	EUR	329.427.500	329.427.500	11,46	0,284%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,182%	09/02/2012	09/02/2017	EUR	9.972.450	9.972.450	44,98	0,498%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,028%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	65.519.000	65.519.000	36,42	0,412%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2,100%	08/02/2012	08/02/2017	EUR	66.363.000	66.363.000	40,14	0,449%	-	Banks	101,500	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,411%	14/11/2012	14/11/2017	EUR	318.647.500	318.647.500	24,54	0,293%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,200%	21/11/2012	21/11/2017	EUR	128.277.000	128.277.000	-	0,399%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,487%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	130.016.000	130.016.000	40,60	0,384%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,200%	24/10/2012	24/10/2017	EUR	129.542.000	129.542.000	-	0,387%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,620%	19/04/2012	19/04/2017	EUR	328.095.000	328.095.000	24,34	0,291%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,250%	30/10/2012	30/10/2017	EUR	129.648.000	129.648.000	-	0,396%	-	Banks	99,305	DE

Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,340%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	130.520.000	130.520.000	-	0,389%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,100%	09/10/2012	09/10/2017	EUR	64.373.000	64.373.000	39,73	0,445%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,000%	09/11/2012	09/11/2017	EUR	127.219.000	127.219.000	46,64	0,444%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,500%	29/08/2012	29/08/2017	EUR	125.271.000	125.271.000	-	0,371%	-	Banks	100,216	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,518%	31/08/2012	31/08/2017	EUR	314.270.000	314.270.000	24,03	0,288%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Saar	1,500%	03/07/2012	03/07/2017	EUR	63.058.000	63.058.000	-	0,113%	-	Banks	100,300	DE
Landesbank Saar	1,200%	07/08/2012	07/08/2017	EUR	93.137.250	93.137.250	-	0,122%	-	Banks	99,940	DE
Landesbank Saar	1,625%	29/08/2012	29/08/2017	EUR	125.271.000	125.271.000	-	0,362%	-	Banks	99,930	DE
Landesbank Saar	0,649%	10/07/2012	10/07/2017	EUR	30.641.000	30.641.000	31,56	0,364%	-	Banks	99,900	DE
Landesbank Saar	0,669%	25/07/2012	25/07/2017	EUR	30.314.750	30.314.750	31,73	0,365%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Saar	0,287%	07/03/2012	07/03/2017	EUR	65.716.500	65.716.500	4,97	0,028%	-	Banks	99,606	DE
Landesbank Saar	0,291%	15/05/2012	15/05/2017	EUR	63.847.000	63.847.000	10,78	0,086%	-	Banks	99,750	DE
Landesbank Saar	2,200%	13/04/2012	13/04/2017	EUR	32.710.500	32.710.500	-	0,421%	-	Banks	99,970	DE
Landesbank Saar	2,125%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	33.630.500	33.630.500	-	0,405%	-	Banks	99,530	DE
Landesbank Saar	0,232%	07/08/2012	07/08/2017	EUR	62.091.500	62.091.500	0,04	0,048%	-	Banks	99,740	DE
Landesbank Saar	1,900%	06/07/2012	06/07/2017	EUR	30.704.250	30.704.250	-	0,442%	-	Banks	99,890	DE
Laurel GmbH	7,125%	16/11/2012	16/11/2017	EUR	25.445.400	25.445.400	-	80,364%	-	Apparel & Textile Products	100,000	DE
LBBW	0,347%	11/12/2012	11/12/2017	EUR	194.988.000	194.988.000	17,50	0,153%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,609%	18/05/2012	18/05/2017	EUR	57.289.500	57.289.500	11,53	0,163%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,500%	12/06/2012	13/07/2017	EUR	62.424.000	62.424.000	-	0,452%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	3,000%	12/06/2012	13/07/2017	EUR	62.424.000	62.424.000	-	0,437%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,169%	23/01/2012	23/01/2017	EUR	32.526.500	32.526.500	5,19	0,100%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,140%	18/04/2012	18/04/2017	EUR	26.231.200	26.231.200	4,40	0,092%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,234%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	13.316.700	13.316.700	8,74	0,135%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,520%	10/07/2012	10/07/2017	EUR	61.282.000	61.282.000	-	0,371%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,919%	16/01/2012	16/01/2017	EUR	6.336.400	6.336.400	22,21	0,270%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,360%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	245.636.000	245.636.000	-	0,288%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,491%	25/10/2012	25/10/2017	EUR	12.963.500	12.963.500	28,34	0,261%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,000%	10/02/2012	10/02/2017	EUR	131.942.000	131.942.000	-	0,319%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,589%	27/07/2012	27/07/2017	EUR	123.564.000	123.564.000	8,19	0,130%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,235%	06/07/2012	06/07/2017	EUR	18.422.550	18.422.550	12,04	0,098%	-	Banks	100,000	DE

LBBW	0,084%	13/06/2012	13/06/2017	EUR	25.162.800	25.162.800	2,96	0,078%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,589%	25/07/2012	25/07/2017	EUR	60.629.500	60.629.500	11,15	0,160%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,300%	24/08/2012	24/08/2017	EUR	125.358.000	125.358.000	-	0,348%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,920%	02/03/2012	02/03/2017	EUR	6.605.350	6.605.350	22,64	0,274%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,648%	31/01/2012	31/01/2017	EUR	98.031.000	98.031.000	8,53	0,133%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,200%	08/10/2012	08/10/2017	EUR	129.740.000	129.740.000	-	0,361%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,500%	17/05/2012	17/05/2017	EUR	63.573.000	63.573.000	23,01	0,208%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,009%	11/05/2012	11/05/2017	EUR	51.766.800	58.237.650	-11,93	0,050%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,149%	22/03/2012	22/03/2017	EUR	145.017.400	145.017.400	-2,97	0,018%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,718%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	67.053.500	67.053.500	10,84	0,156%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,114%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	26.633.400	26.633.400	16,10	0,209%	-	Banks	102,000	DE
LBBW	1,500%	05/06/2012	05/06/2017	EUR	62.192.000	62.192.000	15,58	0,204%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,300%	20/01/2012	20/01/2017	EUR	129.311.000	129.311.000	-	0,323%	-	Banks	100,250	DE
LBBW	0,421%	13/11/2012	13/11/2017	EUR	63.548.000	63.548.000	13,02	0,178%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,666%	18/09/2012	18/09/2017	EUR	6.520.100	6.520.100	11,90	0,288%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,750%	26/03/2012	29/03/2017	EUR	26.656.400	26.656.400	-	0,158%	-	Banks	100,130	DE
LBBW	1,270%	27/11/2012	27/11/2017	EUR	25.877.200	25.877.200	-	0,426%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,875%	04/01/2012	04/01/2017	EUR	12.953.700	12.953.700	-	0,187%	-	Banks	99,920	DE
LBBW	1,400%	25/10/2012	25/10/2017	EUR	129.635.000	129.635.000	-	0,373%	-	Banks	99,950	DE
LBBW	1,000%	19/12/2012	19/12/2017	EUR	66.223.500	66.223.500	-	0,386%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,125%	17/08/2012	17/08/2017	EUR	12.318.100	12.318.100	-	0,179%	-	Banks	99,870	DE
LBBW	0,750%	18/12/2012	18/12/2017	EUR	6.614.950	6.614.950	-	0,218%	-	Banks	100,200	DE
LBBW	0,000%	02/03/2012	02/03/2017	EUR	26.421.400	26.421.400	2,47	0,003%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,600%	24/07/2012	24/07/2017	EUR	120.526.000	120.526.000	-	0,346%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,100%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	132.627.000	132.627.000	-	0,331%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,950%	25/05/2012	25/05/2017	EUR	125.147.000	125.147.000	-	0,342%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,050%	02/05/2012	02/05/2017	EUR	131.670.000	131.670.000	-	0,339%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,300%	22/03/2012	22/03/2017	EUR	131.834.000	131.834.000	-	0,337%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,150%	07/05/2012	07/05/2017	EUR	130.610.000	130.610.000	-	0,343%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,625%	07/02/2012	07/02/2017	EUR	33.145.250	33.145.250	-	0,142%	-	Banks	99,830	DE
LBBW	1,750%	20/11/2012	20/11/2017	EUR	128.060.000	128.060.000	-	0,391%	-	Banks	102,620	DE

LBBW	1,250%	04/12/2012	04/12/2017	EUR	130.924.000	130.924.000	-	0,358%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,000%	02/03/2012	02/03/2017	EUR	132.107.000	132.107.000	-	0,324%	-	Banks	100,250	DE
LBBW	2,000%	13/04/2012	13/04/2017	EUR	130.842.000	130.842.000	-	0,334%	-	Banks	100,750	DE
LBBW	1,950%	07/05/2012	07/05/2017	EUR	130.610.000	130.610.000	-	0,338%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,000%	06/06/2012	06/06/2017	EUR	125.591.000	125.591.000	-	0,346%	-	Banks	100,250	DE
LBBW	1,750%	14/08/2012	14/08/2017	EUR	123.338.000	123.338.000	-	0,357%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,350%	14/09/2012	14/09/2017	EUR	131.207.000	131.207.000	-	0,357%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,350%	21/11/2012	21/11/2017	EUR	128.277.000	128.277.000	-	0,380%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,500%	06/09/2012	06/09/2017	EUR	126.314.000	126.314.000	-	0,358%	-	Banks	100,270	DE
LFA Foerderbank Bayern	1,000%	30/08/2012	30/08/2017	EUR	727.581.480	727.581.480	-	0,028%	-	Government Development Banks	100,225	DE
LFA Foerderbank Bayern	1,050%	10/08/2012	17/07/2017	EUR	12.293.900	12.293.900	-	0,199%	-	Government Development Banks	100,000	DE
Lloyds Bank PLC	4,625%	02/02/2012	02/02/2017	EUR	1.499.562.082	1.972.710.000	-	0,251%	A	Banks	99,703	GB
Lloyds Bank PLC	3,500%	11/01/2012	11/01/2017	EUR	1.587.262.500	1.587.262.500	-	0,014%	-	Banks	99,982	GB
Lloyds Bank PLC	3,050%	01/06/2012	30/05/2017	EUR	5.572.845	5.572.845	-	0,594%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	0,587%	28/11/2012	28/11/2017	EUR	12.941.300	12.941.300	53,33	0,511%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	0,587%	11/12/2012	11/12/2017	EUR	12.999.200	12.999.200	53,66	0,515%	-	Banks	100,000	GB
M&A Investors Luxembourg SA	6,000%	23/08/2012	23/08/2017	EUR	6.288.350	6.288.350	-	3,334%	-	Financial Services	100,000	LU
Malta Government Bond	3,750%	21/08/2012	20/08/2017	EUR	89.797.744	89.797.744	-	0,150%	-	Sovereigns	102,040	MT
MAN SE	2,125%	13/03/2012	13/03/2017	EUR	983.287.500	983.287.500	-	0,278%	NR	Transportation & Logistics	99,677	DE
Mediobanca SpA	2,232%	10/08/2012	10/08/2017	EUR	27.125.261	30.734.750	116,49	1,213%	BBB-	Banks	100,000	IT
Mediobanca SpA	2,157%	21/11/2012	21/11/2017	EUR	62.000.122	62.000.122	118,24	1,230%	BBB-	Banks	100,000	IT
Mediobanca SpA	6,250%	16/01/2012	16/01/2017	EUR	1.267.280.000	1.267.280.000	-	0,719%	-	Banks	100,000	IT
Metro Finance BV	1,299%	27/07/2012	27/07/2017	EUR	61.782.000	61.782.000	67,44	0,722%	BBB-	Supermarkets & Pharmacies	100,000	NL
MITEC Automotive AG	7,750%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	66.662.000	66.662.000	-	7,213%	-	Auto Parts Manufacturing	100,000	DE
MM Warburg & Co Hypothekenbank AG	2,325%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	13.452.200	13.452.200	-	1,023%	-	Consumer Finance	99,980	DE
MM Warburg & Co Hypothekenbank AG	2,250%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	26.258.600	26.258.600	-	0,260%	-	Consumer Finance	100,070	DE
Montana Tech Components GmbH	5,000%	06/06/2012	06/06/2017	EUR	100.472.800	100.472.800	-	3,846%	-	Manufactured Goods	99,900	AT
MTU Aero Engines AG	3,000%	21/06/2012	21/06/2017	EUR	314.157.500	314.157.500	-	0,494%	-	Aerospace & Defense	99,927	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	1,276%	19/06/2012	19/06/2017	EUR	19.037.700	19.037.700	-	0,174%	-	Consumer Finance	100,000	DE

Muenchener Hypothekenbank eG	1,930%	08/03/2012	08/03/2017	EUR	13.262.700	13.262.700	-	0,236%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	1,700%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	19.995.150	19.995.150	-	0,177%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	2,000%	26/01/2012	26/01/2017	EUR	6.574.200	6.574.200	-	0,259%	-	Consumer Finance	99,910	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	3,250%	11/12/2012	11/12/2017	EUR	7.799.520	7.799.520	-	0,369%	-	Consumer Finance	109,990	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	1,500%	12/09/2012	12/09/2017	EUR	6.444.000	6.444.000	-	0,298%	-	Consumer Finance	100,850	DE
Nationwide Building Society	3,125%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	1.333.010.000	1.333.010.000	-	0,341%	A	Banks	99,622	GB
Natixis SA	1,950%	02/08/2012	02/08/2017	EUR	6.082.000	6.082.000	69,06	0,669%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Nederlandse Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	1,675%	16/05/2012	16/05/2017	EUR	82.837.950	82.837.950	-	0,076%	-	Government Development Banks	100,000	NL
Nederlandse Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	0,188%	22/11/2012	22/11/2017	EUR	64.294.500	64.294.500	5,17	0,030%	-	Government Development Banks	100,000	NL
Nederlandse Waterschapsbank NV	0,381%	19/04/2012	19/04/2017	EUR	26.247.600	26.247.600	16,71	0,145%	AA+	Government Agencies	99,754	NL
Neste Oyj	4,000%	28/03/2012	28/03/2017	EUR	332.657.500	332.657.500	-	1,101%	-	Refining & Marketing	99,711	FI
Nokian Renkaat OYJ	3,250%	19/06/2012	19/06/2017	EUR	190.377.000	190.377.000	-	1,382%	-	Auto Parts Manufacturing	99,773	FI
Nomura Bank International PLC	2,000%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	25.355.200	25.355.200	90,86	0,887%	-	Financial Services	100,000	GB
Nomura Bank International PLC	2,900%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	25.355.200	25.355.200	-	0,914%	-	Financial Services	100,000	GB
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,625%	17/07/2012	17/07/2017	EUR	612.250.000	612.250.000	-	0,134%	-	Banks	99,738	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,882%	24/01/2012	24/01/2017	EUR	260.440.000	260.440.000	19,33	0,362%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,000%	28/03/2012	28/03/2017	EUR	26.612.600	26.612.600	49,68	0,475%	-	Banks	101,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,114%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	133.167.000	133.167.000	30,84	0,356%	-	Banks	99,990	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,375%	19/10/2012	19/10/2017	EUR	130.249.000	130.249.000	-	0,509%	-	Banks	99,050	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,181%	18/01/2012	18/01/2017	EUR	257.002.000	257.002.000	34,71	0,325%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,000%	07/11/2012	07/11/2017	EUR	31.905.000	31.905.000	53,74	0,515%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,048%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	262.586.000	262.586.000	27,72	0,325%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,738%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	261.040.000	261.040.000	29,28	0,341%	-	Banks	99,850	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	2,250%	13/03/2012	13/03/2017	EUR	131.105.000	131.105.000	-	0,437%	-	Banks	98,700	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	2,280%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	269.044.000	269.044.000	37,16	0,350%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,200%	06/09/2012	06/09/2017	EUR	63.157.000	63.157.000	-	0,264%	-	Banks	99,530	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	2,070%	02/03/2012	02/03/2017	EUR	13.210.700	13.210.700	56,73	0,545%	-	Banks	99,800	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,250%	27/06/2012	27/06/2017	EUR	24.949.800	24.949.800	53,75	0,516%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,000%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	25.939.400	25.939.400	54,59	0,524%	-	Banks	100,000	DE

Norddeutsche Landesbank Girozentrale	2,140%	15/05/2012	15/05/2017	EUR	255.388.000	255.388.000	-	0,367%	-	Banks	99,900	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	2,250%	02/03/2012	02/03/2017	EUR	6.605.350	6.605.350	44,81	0,426%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,770%	22/08/2012	22/08/2017	EUR	249.346.000	249.346.000	-	0,457%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,000%	02/05/2012	02/05/2017	EUR	26.334.000	26.334.000	50,21	0,480%	-	Banks	100,000	DE
Nordea Bank AB	0,556%	18/12/2012	18/12/2017	EUR	33.074.750	33.074.750	40,46	0,383%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank AB	0,587%	28/11/2012	28/11/2017	EUR	129.413.000	129.413.000	34,22	0,320%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank AB	0,911%	14/08/2012	14/08/2017	EUR	24.667.600	24.667.600	40,16	0,380%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank AB	2,750%	15/02/2012	15/02/2017	EUR	26.122.000	26.122.000	-	0,501%	AA-	Diversified Banks	99,060	SE
Nordea Bank Finland Abp	0,217%	02/11/2012	02/11/2017	EUR	44.894.500	44.894.500	5,48	0,033%	-	Banks	100,000	FI
Novo Banco SA	5,750%	08/06/2012	28/06/2017	EUR	249.836.000	249.836.000	-	3,986%	-	Banks	76,819	PT
Nykredit Realkredit A/S	3,250%	01/06/2012	01/06/2017	EUR	928.807.500	928.807.500	-	0,339%	A+ /*-	Consumer Finance	99,868	DK
Oberbank AG	2,750%	09/05/2012	09/05/2017	EUR	64.755.500	64.755.500	-	1,133%	-	Banks	100,000	AT
Oberbank AG	2,000%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	61.409.000	61.409.000	-	1,142%	-	Banks	100,000	AT
Oberbank AG	2,500%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	65.519.000	65.519.000	-	1,101%	-	Banks	100,000	AT
Oesterreichische Apothekerbank rGmbH	2,500%	24/04/2012	24/04/2017	EUR	6.598.900	6.598.900	139,21	1,370%	-	Banks	100,000	AT
Omega Pharma Invest NV	5,125%	12/12/2012	12/12/2017	EUR	392.643.000	392.643.000	-	2,051%	-	Medical Equipment & Devices Manufacturing	101,875	BE
Omega Pharma NV	4,500%	23/05/2012	23/05/2017	EUR	226.087.200	226.087.200	-	2,013%	-	Pharmaceuticals	101,875	BE
OP Mortgage Bank	0,188%	24/08/2012	24/08/2017	EUR	31.339.500	31.339.500	4,09	0,019%	AAA	Commercial Finance	99,750	FI
OP Mortgage Bank	0,238%	24/08/2012	24/08/2017	EUR	94.018.500	94.018.500	12,19	0,100%	AAA	Commercial Finance	100,000	FI
Operateur des Reseaux Gaz & Electric	3,428%	16/03/2012	16/03/2017	EUR	25.020.150	25.020.150	-	0,722%	-	Utilities	100,000	BE
Operateur des Reseaux Gaz & Electric	3,150%	24/05/2012	24/05/2017	EUR	50.181.200	50.181.200	-	0,696%	-	Utilities	100,000	BE
PGNIG Finance AB	4,000%	14/02/2012	14/02/2017	EUR	655.900.000	655.900.000	-	0,991%	BBB-	Integrated Oils	99,565	SE
Pohjola Bank Oyj	2,625%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	992.310.000	992.310.000	-	0,223%	AA-	Banks	99,797	FI
Pohjola Bank Oyj	0,887%	30/05/2012	30/05/2017	EUR	74.437.200	74.437.200	24,16	0,220%	-	Banks	99,806	FI
Publity Capital Partners Sarl	8,000%	05/06/2012	04/06/2017	EUR	12.438.400	12.438.400	-	2,058%	-	Financial Services	100,000	LU
Raiffeisen Bank International AG	2,750%	10/07/2012	10/07/2017	EUR	919.230.000	919.230.000	-	1,027%	BBB	Banks	99,389	AT
Raiffeisen Bank International AG	2,050%	18/10/2012	18/10/2017	EUR	81.235.500	91.717.500	115,24	1,130%	BBB	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	2,331%	27/01/2012	27/01/2017	EUR	131.740.000	131.740.000	99,40	0,972%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	2,000%	03/08/2012	03/08/2017	EUR	52.576.325	55.669.050	108,44	1,062%	BBB	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	4,000%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	33.630.500	33.630.500	-	1,291%	-	Banks	96,660	AT

Raiffeisen Bank International AG	2,980%	07/03/2012	07/03/2017	EUR	6.571.650	6.571.650	-	1,370%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	3,000%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	6.666.200	6.666.200	46,49	0,634%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	1,780%	16/11/2012	16/11/2017	EUR	31.806.750	31.806.750	114,54	1,123%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,631%	20/04/2012	20/04/2017	EUR	64.738.310	64.738.310	120,26	1,181%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	3,500%	20/04/2012	20/04/2017	EUR	64.738.310	64.738.310	-	1,076%	-	Banks	100,450	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,291%	16/05/2012	16/05/2017	EUR	62.447.070	62.447.070	120,45	1,183%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	2,132%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	62.120.240	62.120.240	117,93	1,157%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,428%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	63.551.530	63.551.530	126,81	1,246%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,750%	10/09/2012	10/09/2017	EUR	62.638.660	62.638.660	109,77	1,267%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	2,350%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	63.551.530	63.551.530	-	1,117%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Kaernten GmbH	3,000%	09/01/2012	09/01/2017	EUR	62.414.730	62.414.730	-	1,050%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	2,500%	28/06/2012	28/06/2017	EUR	57.481.460	62.126.000	205,37	2,032%	-	Banks	101,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,750%	05/10/2012	05/10/2017	EUR	52.208.000	52.208.000	203,19	2,010%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,940%	22/11/2012	22/11/2017	EUR	6.429.450	6.429.450	-	2,166%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	2,500%	22/05/2012	22/05/2017	EUR	16.416.446	17.041.774	177,20	1,750%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,330%	06/03/2012	06/03/2017	EUR	3.934.380	3.934.380	203,53	2,083%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	2,000%	13/11/2012	13/11/2017	EUR	3.177.400	3.177.400	-	2,194%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,203%	06/11/2012	06/11/2017	EUR	3.844.440	3.844.440	211,73	2,095%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	1,750%	09/10/2012	09/10/2017	EUR	87.676.026	51.498.400	143,71	1,415%	-	Banks	100,550	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	2,500%	10/07/2012	10/07/2017	EUR	21.693.828	49.025.600	148,82	1,466%	-	Banks	101,200	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	2,000%	04/09/2012	04/09/2017	EUR	75.366.000	75.366.000	141,99	1,398%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	2,000%	29/08/2012	29/08/2017	EUR	3.758.130	3.758.130	-	1,308%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	2,500%	03/04/2012	03/04/2017	EUR	69.449.821	266.602.000	140,16	1,380%	-	Banks	101,000	AT
Raiffeisen-Landesbank Tirol AG	0,988%	23/02/2012	23/02/2017	EUR	26.630.400	26.630.400	121,57	1,194%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	0,000%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	55.268.100	55.268.100	138,17	1,308%	-	Banks	100,000	AT

Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	1,500%	30/07/2012	30/07/2017	EUR	12.261.800	12.261.800	131,04	1,288%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	0,977%	02/11/2012	02/11/2017	EUR	12.827.000	12.827.000	131,49	1,293%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	1,250%	21/12/2012	21/12/2017	EUR	13.169.000	13.169.000	138,96	1,368%	-	Banks	100,300	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	0,927%	11/12/2012	11/12/2017	EUR	1.949.880	1.949.880	141,27	1,391%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenverband Salzburg	2,250%	12/03/2012	12/03/2017	EUR	39.444.600	39.444.600	-	1,061%	-	Banks	100,250	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,750%	30/07/2012	30/07/2017	EUR	36.785.400	36.785.400	-	1,092%	-	Banks	100,400	AT
Raiffeisenverband Salzburg	0,500%	30/08/2012	30/08/2017	EUR	37.504.200	37.504.200	130,45	1,282%	-	Banks	100,250	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,750%	14/02/2012	14/02/2017	EUR	39.354.000	39.354.000	126,16	1,240%	-	Banks	100,150	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,500%	03/12/2012	03/12/2017	EUR	39.165.600	39.165.600	-	1,141%	-	Banks	100,450	AT
Raiffeisenverband Salzburg	0,150%	03/01/2012	03/01/2017	EUR	39.146.100	39.146.100	113,38	1,182%	-	Banks	100,650	AT
RCI Banque SA	4,250%	27/04/2012	27/04/2017	EUR	994.207.500	994.207.500	-	0,486%	BBB	Automobiles Manufacturing	99,441	FR
Region Wallonne Belgium	2,523%	29/05/2012	29/05/2017	EUR	31.206.000	31.206.000	-	0,286%	-	Government Regional	99,907	BE
Renault SA	4,625%	18/09/2012	18/09/2017	EUR	1.108.417.000	1.108.417.000	-	0,814%	BBB-	Automobiles Manufacturing	99,891	FR
Rettig Ab Oy	5,250%	25/06/2012	25/06/2017	EUR	124.978.000	124.978.000	-	1,486%	-	Electrical Equipment Manufacturing	99,863	FI
Royal Bank of Scotland PLC/The	1,800%	17/10/2012	17/10/2017	EUR	2.623.800	2.623.800	-	1,162%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	0,000%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	6.666.200	6.666.200	180,24	1,780%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	2,450%	16/05/2012	16/05/2017	EUR	8.921.010	8.921.010	105,24	1,030%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	2,550%	20/06/2012	20/06/2017	EUR	6.346.150	6.346.150	-	1,079%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	2,750%	18/07/2012	18/07/2017	EUR	6.132.800	6.132.800	-	1,101%	-	Banks	101,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	1,450%	19/12/2012	19/12/2017	EUR	3.973.410	3.973.410	-	1,171%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	0,086%	12/12/2012	12/12/2017	EUR	6.544.050	6.544.050	84,16	0,890%	-	Banks	100,000	GB
Sampo Oyj	4,250%	27/02/2012	27/02/2017	EUR	670.535.000	670.535.000	-	0,389%	-	Property & Casualty Insurance	99,568	FI
Royal Bank of Scotland PLC/The	2,900%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	6.666.200	6.666.200	-	1,041%	-	Banks	100,000	GB
Rural Cedula I FTA	4,000%	13/03/2012	13/03/2017	EUR	1.311.050.000	1.311.050.000	-	0,258%	-	Financial Services	100,000	ES
Sanochemia Pharmazeutika AG	7,750%	06/08/2012	05/08/2017	EUR	18.615.150	18.615.150	-	7,196%	-	Pharmaceuticals	100,000	AT
Sanofi	1,000%	14/11/2012	14/11/2017	EUR	955.942.500	955.942.500	-	0,154%	AA	Pharmaceuticals	99,758	FR
Sanoma OYJ	5,000%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	529.232.000	529.232.000	-	1,501%	-	Publishing & Broadcasting	99,413	FI

Santander International Debt SAU	4,000%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	1.493.033.332	1.493.033.332	-	0,508%	BBB+	Financial Services	99,951	ES
SBAB Bank AB	1,130%	19/04/2012	19/04/2017	EUR	32.809.500	32.809.500	32,44	0,372%	A	Consumer Finance	100,000	SE
Scania CV AB	1,625%	14/09/2012	14/09/2017	EUR	459.224.500	459.224.500	-	0,325%	A-	Transportation & Logistics	99,648	SE
Scholz Holding GmbH	8,500%	08/03/2012	08/03/2017	EUR	242.044.275	242.044.275	-	5,987%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	DE
SEB AG	2,250%	06/03/2012	06/03/2017	EUR	4.590.110	4.590.110	58,56	0,634%	-	Banks	100,000	DE
Securitas AB	2,750%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	470.827.000	470.827.000	-	0,440%	BBB	Consumer Services	99,430	SE
Skandinaviska Enskilda Banken AB	1,152%	11/01/2012	11/01/2017	EUR	7.618.860	7.618.860	39,04	0,368%	-	Banks	100,000	SE
SNS Bank NV	2,125%	30/08/2012	30/08/2017	EUR	1.250.140.000	1.250.140.000	-	0,016%	-	Banks	99,995	NL
Societe Fonciere Lyonnaise SA	3,500%	28/11/2012	28/11/2017	EUR	517.652.000	647.065.000	-	0,867%	BBB	Real Estate	99,541	FR
Societe Generale Effekten GmbH	2,900%	09/08/2012	09/08/2017	EUR	61.409.000	61.409.000	164,23	1,620%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	2,750%	28/06/2012	28/06/2017	EUR	62.126.000	62.126.000	170,33	1,681%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	0,000%	21/09/2012	21/09/2017	EUR	65.012.500	65.012.500	7,08	0,049%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	2,900%	05/07/2012	05/07/2017	EUR	61.966.500	61.966.500	168,45	1,663%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	3,100%	05/12/2012	10/01/2018	EUR	65.429.500	65.429.500	-	2,513%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	4,000%	20/07/2012	10/07/2017	EUR	60.865.000	60.865.000	-	2,025%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	3,400%	06/07/2012	06/07/2017	EUR	61.408.500	61.408.500	194,60	1,924%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	2,500%	30/05/2012	30/05/2017	EUR	62.031.000	62.031.000	149,50	1,473%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	0,145%	29/05/2012	29/05/2017	EUR	62.412.000	62.412.000	57,95	0,724%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	3,750%	14/03/2012	14/03/2017	EUR	65.088.500	65.088.500	137,76	1,356%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale SA	3,750%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	1.464.837.000	1.464.837.000	-	0,285%	A	Diversified Banks	99,682	FR
Societe Generale SA	0,970%	19/11/2012	19/11/2017	EUR	320.057.500	320.057.500	32,56	0,304%	A	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Generale SA	3,250%	22/03/2012	22/03/2017	EUR	131.834.000	131.834.000	-	0,658%	A	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Generale SA	6,500%	02/04/2012	10/04/2017	EUR	3.505.396	6.664.250	-	1,496%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Generale SA	4,000%	27/07/2012	10/07/2017	EUR	2.471.280	2.471.280	-	2,799%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Generale SA	4,400%	20/01/2012	10/01/2017	EUR	38.793.300	38.793.300	-	0,945%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Generale SFH SA	1,000%	19/12/2012	19/12/2017	EUR	1.986.705.000	1.986.705.000	-	0,027%	-	Banks	99,617	FR
Societe Publique de Gestion de l'Eau SA	1,880%	16/11/2012	16/11/2017	EUR	12.722.700	12.722.700	-	0,639%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	BE
Societe Publique de Gestion de l'Eau SA	1,980%	19/09/2012	19/09/2017	EUR	20.583.518	20.583.518	-	0,596%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	BE
Spar Oesterreichische Warenhandels AG	3,500%	21/09/2012	21/09/2017	EUR	260.050.000	260.050.000	-	1,624%	-	Supermarkets & Pharmacies	101,400	AT

SpareBank 1 SR-Bank ASA	3,500%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	666.890.000	666.890.000	-	0,267%	-	Banks	99,581	NO
Sparebanken Vest Boligkreditt AS	0,495%	29/06/2012	29/06/2017	EUR	126.511.000	126.511.000	14,61	0,124%	-	Consumer Finance	100,000	NO
Sparkasse Bielefeld	1,750%	21/03/2012	21/03/2017	EUR	6.598.850	6.598.850	-	0,544%	-	Banks	100,400	DE
Sparkasse Bremerhaven	1,350%	04/09/2012	04/09/2017	EUR	6.280.500	6.280.500	-	0,639%	-	Banks	100,450	DE
Sparkasse Essen	1,280%	26/07/2012	26/07/2017	EUR	6.139.250	6.139.250	-	0,312%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse KoelnBonn	1,250%	03/09/2012	05/09/2017	EUR	25.195.600	25.195.600	-	0,523%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Kufstein - Tiroler Sparkasse von 1877	2,000%	20/12/2012	20/12/2017	EUR	6.620.200	6.620.200	-	1,449%	-	Banks	100,400	AT
Sparkasse Kulmbach-Kronach	1,000%	01/07/2012	01/07/2017	EUR	6.295.950	6.295.950	-	0,602%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Niederoesterreich Mitte West AG	2,570%	26/01/2012	26/01/2017	EUR	26.296.800	26.296.800	-	0,280%	-	Banks	100,000	AT
Sparkasse Rosenheim-Bad Aibling	1,500%	30/04/2012	30/04/2017	EUR	6.614.550	6.614.550	-	0,547%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Rosenheim-Bad Aibling	1,500%	22/10/2012	22/10/2017	EUR	6.529.600	6.529.600	-	0,613%	-	Banks	100,500	DE
Sparkasse Schwaz AG	3,000%	02/01/2012	02/01/2017	EUR	6.466.000	6.466.000	-	1,271%	-	Banks	100,250	AT
Sparkasse Suedholstein	2,250%	06/02/2012	06/02/2017	EUR	13.128.200	13.128.200	-	0,539%	-	Banks	99,920	DE
Sparkasse zu Luebeck AG	2,300%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	6.564.650	6.564.650	-	0,731%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse zu Luebeck AG	2,000%	01/02/2012	01/02/2017	EUR	6.592.000	6.592.000	-	0,724%	-	Banks	103,350	DE
Sparkasse zu Luebeck AG	2,300%	16/02/2012	16/02/2017	EUR	6.551.900	6.551.900	-	0,737%	-	Banks	100,000	DE
Sponda OYJ	4,125%	29/05/2012	29/05/2017	EUR	187.236.000	187.236.000	-	1,041%	-	Real Estate	99,443	FI
Stadt- und Kreissparkasse Erlangen	1,000%	30/10/2012	30/10/2017	EUR	9.075.360	9.075.360	-	0,580%	-	Banks	99,900	DE
Stadtsparkasse Moenchengladbach	1,750%	01/03/2012	01/03/2017	EUR	6.658.350	6.658.350	-	0,669%	-	Banks	100,000	DE
Stadtsparkasse Moenchengladbach	2,000%	02/01/2012	02/01/2017	EUR	6.466.000	6.466.000	-	0,656%	-	Banks	100,000	DE
Stadtsparkasse Moenchengladbach	1,350%	01/10/2012	01/10/2017	EUR	6.448.450	6.448.450	-	0,738%	-	Banks	100,000	DE
Stadtsparkasse Muenchen	1,400%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	6.338.800	6.338.800	-	0,648%	-	Banks	100,530	DE
Stadtsparkasse Wunstorf	2,750%	01/04/2012	01/04/2017	EUR	6.664.250	6.664.250	-	0,559%	-	Banks	101,100	DE
Stadtsparkasse Wuppertal	1,500%	24/02/2012	24/02/2017	EUR	13.462.500	13.462.500	-	0,540%	-	Banks	100,000	DE
Standard Chartered PLC	1,750%	29/10/2012	29/10/2017	EUR	1.612.400.000	1.612.400.000	-	0,436%	A-	Diversified Banks	99,877	GB
State of Berlin	1,000%	26/07/2012	26/07/2017	EUR	184.177.500	184.177.500	-	0,073%	-	Government Local	99,960	DE
State of Brandenburg	0,875%	11/10/2012	11/10/2017	EUR	129.406.000	129.406.000	-	0,166%	-	Government Regional	100,000	DE
State of Mecklenburg-Western Pomerania	1,680%	17/01/2012	17/01/2017	EUR	63.664.500	63.664.500	-	0,048%	-	Government Regional	100,000	DE
State of Rhineland-Palatinate	0,850%	18/10/2012	18/10/2017	EUR	196.537.500	196.537.500	-	0,090%	-	Government Regional	100,000	DE
Steiermaerkische Bank und Sparkassen AG	3,125%	23/07/2012	23/07/2017	EUR	40.738.202	59.462.970	-	1,171%	-	Banks	102,450	AT
Steiermaerkische Bank und Sparkassen AG	3,125%	10/12/2012	10/12/2017	EUR	63.392.280	63.392.280	-	1,214%	-	Banks	105,000	AT

Steilmann-Boecker Fashion Point GmbH & Co KG	6,750%	27/06/2012	27/06/2017	EUR	49.899.600	49.899.600	-	5,566%	-	Retail - Consumer Discretionary	100,000	DE
Swedbank AB	3,375%	02/02/2012	09/02/2017	EUR	1.315.140.000	1.315.140.000	-	0,264%	A+	Banks	99,550	SE
Swedbank AB	0,866%	20/09/2012	20/09/2017	EUR	1.012.064.400	1.012.064.400	21,84	0,196%	A+	Banks	100,000	SE
Swedbank AB	1,642%	07/02/2012	07/02/2017	EUR	26.516.200	26.516.200	35,93	0,337%	A+	Banks	100,000	SE
Swedbank AB	1,385%	29/03/2012	29/03/2017	EUR	26.548.000	26.548.000	36,67	0,345%	A+	Banks	100,000	SE
Swedbank Hypotek AB	0,487%	09/03/2012	09/03/2017	EUR	131.178.000	131.178.000	6,04	0,038%	AAA	Consumer Finance	99,464	SE
Swedbank Hypotek AB	0,157%	01/11/2012	01/11/2017	EUR	64.669.000	64.669.000	10,22	0,080%	AAA	Consumer Finance	100,000	SE
Swedbank Hypotek AB	0,157%	02/11/2012	02/11/2017	EUR	64.135.000	64.135.000	7,50	0,053%	AAA	Consumer Finance	100,000	SE
Swedbank Hypotek AB	0,186%	13/09/2012	13/09/2017	EUR	19.362.150	19.362.150	10,11	0,079%	AAA	Consumer Finance	100,000	SE
Swedbank Hypotek AB	0,556%	21/03/2012	21/03/2017	EUR	32.994.250	32.994.250	20,20	0,180%	AAA	Consumer Finance	100,000	SE
Swedbank Hypotek AB	1,000%	11/09/2012	11/09/2017	EUR	12.862.700	12.862.700	-	0,797%	AAA	Consumer Finance	100,000	SE
Telecom Italia SpA	4,500%	20/09/2012	20/09/2017	EUR	813.035.853	1.294.200.000	-	1,022%	BB+	Wireless Telecommunications Services	99,693	IT
Telefonica Emisiones SAU	5,811%	19/09/2012	05/09/2017	EUR	1.306.890.000	1.306.890.000	-	0,498%	BBB	Wireline Telecommunications Services	100,000	ES
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	4,125%	17/02/2012	17/02/2017	EUR	1.012.759.215	1.644.087.500	-	0,240%	BBB	Utilities	99,809	IT
ThyssenKrupp AG	4,375%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	1.681.525.000	1.681.525.000	-	1,155%	BB	Metals & Mining	99,753	DE
UBS AG/Jersey	1,800%	07/03/2012	07/03/2017	EUR	1.314.330	1.314.330	70,29	0,681%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	1,700%	30/04/2012	28/04/2017	EUR	5.291.640	13.229.100	60,46	0,583%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,500%	22/02/2012	22/02/2017	EUR	5.297.880	5.297.880	59,90	0,577%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	2,250%	15/02/2012	15/02/2017	EUR	9.795.750	9.795.750	56,20	0,540%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	1,000%	08/08/2012	08/08/2017	EUR	1.236.760	1.236.760	64,94	0,627%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	0,950%	22/08/2012	22/08/2017	EUR	6.981.688	6.981.688	61,93	0,597%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/Jersey	1,700%	18/05/2012	18/05/2017	EUR	6.365.500	6.365.500	60,57	0,584%	-	Banks	100,000	JE
UBS AG/London	2,250%	10/01/2012	10/01/2017	EUR	1.916.700.000	1.916.700.000	-	0,041%	-	Banks	99,692	GB
UBS AG/London	2,490%	21/03/2012	21/03/2017	EUR	1.319.770	6.598.850	-	0,617%	-	Banks	100,000	GB
Unicaja Banco SA	4,203%	27/03/2012	27/03/2017	EUR	933.646.000	933.646.000	-	0,156%	-	Banks	100,000	ES
Unicaja Banco SA	6,900%	20/06/2012	20/06/2017	EUR	380.769.000	380.769.000	-	0,501%	-	Banks	100,000	ES
Unicaja Banco SA	6,250%	23/05/2012	23/05/2017	EUR	376.812.000	376.812.000	-	0,501%	-	Banks	100,000	ES

UniCredit Bank AG	2,450%	08/03/2012	08/03/2017	EUR	26.525.400	26.525.400	-	0,521%	BBB	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	2,250%	10/01/2012	10/01/2017	EUR	9.583.500	9.583.500	52,25	0,500%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,800%	23/10/2012	20/10/2017	EUR	5.190.280	64.878.500	-	1,174%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	2,000%	24/07/2012	24/07/2017	EUR	7.231.560	7.231.560	-	0,610%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,700%	11/10/2012	11/10/2017	EUR	9.058.420	9.058.420	-	0,632%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	4,250%	02/10/2012	20/10/2017	EUR	7.117.825	7.117.825	-	1,641%	-	Banks	101,500	DE
UniCredit Bank AG	1,750%	21/11/2012	21/11/2017	EUR	70.552.350	70.552.350	-	0,564%	BBB	Banks	99,650	DE
UniCredit Bank AG	2,300%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	9.332.680	19.998.600	-	0,570%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,800%	30/08/2012	30/08/2017	EUR	8.750.980	8.750.980	-	0,614%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,400%	30/11/2012	30/11/2017	EUR	5.200.640	130.016.000	-	0,672%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,431%	26/07/2012	26/07/2017	EUR	122.785.000	122.785.000	38,64	0,364%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,100%	19/06/2012	19/06/2017	EUR	3.807.540	3.807.540	-	0,631%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,000%	15/03/2012	15/03/2017	EUR	26.202.600	26.202.600	49,02	0,468%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,570%	07/05/2012	07/05/2017	EUR	13.061.000	13.061.000	-	0,206%	NR	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,050%	21/03/2012	21/03/2017	EUR	13.197.700	13.197.700	-	0,218%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,456%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	165.783.750	165.783.750	15,30	0,131%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,000%	30/01/2012	30/01/2017	EUR	19.693.950	19.693.950	-	0,197%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,600%	07/02/2012	07/02/2017	EUR	13.258.100	13.258.100	-	0,546%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,150%	07/02/2012	07/02/2017	EUR	13.258.100	13.258.100	51,50	0,493%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,510%	04/07/2012	04/07/2017	EUR	12.542.900	12.542.900	-	0,206%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,038%	23/11/2012	23/11/2017	EUR	64.930.500	64.930.500	45,18	0,430%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,800%	10/01/2012	10/01/2017	EUR	12.778.000	12.778.000	-	0,541%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,900%	30/10/2012	30/10/2017	EUR	38.894.400	38.894.400	-	0,583%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank Austria AG	1,532%	10/07/2012	10/07/2017	EUR	14.707.680	14.707.680	136,35	1,341%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	3,500%	20/01/2012	20/01/2017	EUR	30.388.085	64.655.500	134,58	1,324%	-	Banks	101,500	AT
UniCredit Bank Austria AG	3,000%	10/04/2012	10/04/2017	EUR	36.914.082	36.914.082	136,49	1,343%	-	Banks	101,500	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,700%	28/12/2012	28/12/2017	EUR	12.925.925	66.110.500	147,75	1,455%	-	Banks	101,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	2,500%	25/05/2012	25/05/2017	EUR	25.029.400	62.573.500	137,87	1,357%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	2,000%	16/11/2012	16/11/2017	EUR	2.544.540	2.544.540	153,51	1,513%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit SpA	0,000%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	907.879.000	907.879.000	-	1,281%	-	Banks	84,950	IT
UniCredit SpA	4,875%	07/03/2012	07/03/2017	EUR	1.971.495.000	1.971.495.000	-	0,727%	BBB-	Banks	99,485	IT

UniCredit SpA	3,375%	11/12/2012	11/01/2018	EUR	1.299.920.000	1.299.920.000	-	0,776%	BBB-	Banks	99,687	IT
UniCredit SpA	5,448%	31/08/2012	30/08/2017	EUR	142.175.748	142.175.748	-	1,235%	-	Banks	100,000	IT
UniCredit SpA	4,000%	31/10/2012	31/10/2017	EUR	53.059.043	53.059.043	-	1,291%	-	Banks	100,000	IT
UniCredit SpA	4,000%	09/05/2012	09/05/2017	EUR	75.738.033	75.738.033	-	1,169%	-	Banks	98,500	IT
UniCredit SpA	2,986%	20/03/2012	20/03/2017	EUR	33.077.000	33.077.000	142,25	1,401%	-	Banks	100,000	IT
UniCredit SpA	5,970%	16/01/2012	16/01/2017	EUR	1.013.824.000	1.013.824.000	-	0,956%	-	Banks	100,000	IT
UniCredit SpA	2,986%	09/03/2012	20/03/2017	EUR	32.794.500	32.794.500	142,25	1,401%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	7,000%	02/01/2012	02/01/2017	EUR	1.293.200.000	1.293.200.000	-	0,842%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	5,550%	20/01/2012	20/01/2017	EUR	258.622.000	258.622.000	-	0,811%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	5,000%	13/02/2012	13/02/2017	EUR	5.296.689	5.296.689	-	1,933%	-	Banks	100,000	IT
Valeo SA	5,750%	19/01/2012	19/01/2017	EUR	188.282.640	646.575.000	-	0,372%	-	Auto Parts Manufacturing	99,683	FR
Vandemoortele NV	5,125%	13/12/2012	13/12/2017	EUR	98.021.250	98.021.250	-	2,193%	-	Food & Beverage	101,875	BE
Veneto Banca SCPA	4,500%	06/12/2012	06/12/2017	EUR	12.953.700	12.953.700	-	3,810%	B+	Banks	99,344	IT
Veneto Banca SpA	5,000%	23/03/2012	23/03/2017	EUR	397.881.000	397.881.000	-	4,982%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	3,000%	02/04/2012	02/04/2017	EUR	62.643.950	62.643.950	264,94	2,697%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	3,000%	06/02/2012	06/02/2017	EUR	4.636.880	6.564.100	261,26	2,661%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	2,000%	04/06/2012	04/06/2017	EUR	20.814.378	20.814.378	273,11	2,779%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	3,600%	06/11/2012	06/11/2017	EUR	3.203.700	3.203.700	-	3,102%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	0,000%	18/09/2012	18/09/2017	EUR	860.653	860.653	-	3,014%	-	Banks	78,342	IT
Veneto Banca SpA	0,000%	05/09/2012	05/09/2017	EUR	2.067.154	2.067.154	-	3,000%	-	Banks	78,342	IT
Volksbank Bonn Rhein-Sieg eG	1,000%	27/06/2012	27/06/2017	EUR	3.118.725	3.118.725	50,03	0,548%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank eG Nienburg/Weser	2,000%	15/07/2012	15/07/2017	EUR	6.130.250	6.130.250	-	0,670%	-	Banks	100,000	DE
Volkswagen International Finance NV	1,875%	15/05/2012	15/05/2017	EUR	1.915.410.000	1.915.410.000	-	0,269%	A	Automobiles Manufacturing	99,378	NL
Volkswagen International Finance NV	2,125%	30/03/2012	30/03/2017	EUR	66.662.000	66.662.000	-	0,457%	A	Automobiles Manufacturing	100,000	NL
Vontobel Financial Products GmbH	1,625%	06/06/2012	06/06/2017	EUR	31.397.750	31.397.750	68,15	0,660%	-	Banks	100,000	DE
VR-Bank Landau eG	1,950%	29/02/2012	28/02/2017	EUR	14.692.920	14.692.920	-	0,570%	-	Banks	100,000	DE
VR-Bank Rhein-Sieg eG	0,298%	01/08/2012	01/08/2017	EUR	9.224.625	9.224.625	50,00	0,548%	-	Banks	100,500	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,299%	13/03/2012	13/03/2017	EUR	131.105.000	131.105.000	31,58	0,364%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,632%	13/01/2012	13/01/2017	EUR	63.388.000	63.388.000	41,63	0,394%	-	Banks	100,000	DE

WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,150%	15/11/2012	15/12/2017	EUR	159.660.000	159.660.000	-	0,423%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,500%	06/01/2012	06/01/2017	EUR	12.721.300	12.721.300	52,60	0,504%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,500%	11/05/2012	11/05/2017	EUR	64.708.500	64.708.500	-	0,453%	-	Banks	99,760	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,875%	13/02/2012	13/02/2017	EUR	66.043.500	66.043.500	-	0,459%	-	Banks	99,960	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,349%	16/11/2012	16/11/2017	EUR	25.445.400	25.445.400	36,65	0,415%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,300%	26/10/2012	26/10/2017	EUR	12.930.000	12.930.000	-	0,537%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,300%	14/09/2012	13/09/2017	EUR	65.603.500	65.603.500	-	0,459%	-	Banks	100,000	DE
Windkraft Simonsfeld AG	5,000%	24/10/2012	24/10/2017	EUR	22.022.140	22.022.140	-	1,623%	-	Renewable Energy	101,000	AT
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,126%	05/09/2012	05/09/2017	EUR	63.023.000	63.023.000	2,99	0,008%	AAA	Consumer Finance	99,925	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,249%	13/02/2012	13/02/2017	EUR	26.417.400	26.417.400	10,19	0,150%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,148%	03/08/2012	03/08/2017	EUR	30.927.250	30.927.250	6,32	0,111%	AAA	Consumer Finance	100,390	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1,875%	29/03/2012	29/03/2017	EUR	39.822.000	39.822.000	-	0,799%	AA-	Consumer Finance	99,960	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,398%	14/03/2012	14/03/2017	EUR	13.017.700	13.017.700	73,80	0,786%	AA-	Consumer Finance	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1,710%	23/01/2012	23/01/2017	EUR	130.106.000	130.106.000	-	0,108%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	2,000%	11/12/2012	11/12/2017	EUR	25.998.400	25.998.400	-	0,872%	AA-	Consumer Finance	104,560	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1,250%	12/06/2012	12/06/2017	EUR	49.939.200	49.939.200	-	0,125%	AAA	Consumer Finance	100,230	DE
Wuestenrot Bank AG Pfandbriefbank	1,250%	17/10/2012	17/10/2017	EUR	6.559.500	6.559.500	-	1,086%	-	Consumer Finance	99,500	DE

Emisión de Bonos en Europa en el año 2013– Fuente Bloomberg

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
Aareal Bank AG	1,000%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	812.825.000	812.825.000	-	0,014%	-	Financial Services	99,487	DE
Aareal Bank AG	1,500%	02/07/2013	02/07/2018	EUR	58.587.300	58.587.300	-	0,164%	-	Financial Services	99,540	DE
Aareal Bank AG	0,104%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	27.148.000	27.148.000	24,92	0,227%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,235%	18/01/2013	15/12/2017	EUR	13.320.700	13.320.700	-	0,173%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,365%	30/12/2013	28/12/2018	EUR	41.400.900	41.400.900	21,28	0,191%	-	Financial Services	99,900	DE
Aareal Bank AG	0,049%	25/01/2013	25/01/2018	EUR	13.451.500	13.451.500	20,31	0,251%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,509%	20/02/2013	20/02/2018	EUR	13.344.000	13.344.000	55,68	0,535%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	1,100%	12/07/2013	12/07/2018	EUR	32.689.250	32.689.250	-	0,179%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,580%	19/02/2013	19/02/2018	EUR	5.355.400	5.355.400	60,69	0,585%	-	Financial Services	100,000	DE
Aareal Bank AG	0,386%	05/12/2013	05/12/2018	EUR	68.323.500	68.323.500	16,96	0,148%	-	Financial Services	99,990	DE
Aareal Bank AG	1,700%	21/11/2013	21/11/2018	EUR	26.917.800	26.917.800	-	0,690%	-	Financial Services	100,720	DE
Abbey National Treasury Services PLC/London	1,750%	15/01/2013	15/01/2018	EUR	1.333.500.000	1.333.500.000	-	0,528%	A	Banks	99,432	GB
Abengoa Finance SAU	8,875%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	747.120.000	747.120.000	-	11,602%	B+	Industrial Other	100,000	ES
Abengoa Finance SAU	8,875%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	747.120.000	747.120.000	-	9,547%	B+	Industrial Other	100,000	ES
ABN AMRO Bank NV	2,000%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	135.740.000	135.740.000	-	0,761%	-	Banks	100,000	NL
ABN AMRO Bank NV	0,631%	25/04/2013	25/04/2018	EUR	28.317.110	28.317.110	60,90	0,587%	-	Banks	100,000	NL
ABN AMRO Bank NV	0,681%	21/01/2013	21/01/2018	EUR	33.292.250	33.292.250	55,09	0,529%	-	Banks	100,000	NL
ACEA SpA	3,750%	12/09/2013	12/09/2018	EUR	798.636.000	798.636.000	-	0,674%	BBB-	Utilities	99,754	IT
Achmea Bank NV	2,000%	23/01/2013	23/01/2018	EUR	665.370.000	665.370.000	-	0,664%	A	Consumer Finance	99,661	NL
Achmea Bank NV	1,149%	26/07/2013	26/07/2018	EUR	6.640.100	6.640.100	81,29	0,861%	-	Consumer Finance	100,000	NL
ADLER Real Estate AG	8,750%	03/04/2013	03/04/2018	EUR	44.958.200	44.958.200	-	3,420%	-	Real Estate	100,000	DE
Agence Francaise de Developpement	0,186%	19/09/2013	19/09/2018	EUR	405.453.000	405.453.000	5,27	0,031%	AA	Government Development Banks	100,000	FR

Agence Francaise de Developpement	0,317%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	410.142.000	410.142.000	14,49	0,123%	AA	Government Development Banks	100,000	FR
AIB Mortgage Bank	3,125%	10/09/2013	10/09/2018	EUR	663.000.000	663.000.000	-	0,322%	AA	Consumer Finance	99,704	IE
Aktia Bank PLC	1,125%	25/06/2013	25/06/2018	EUR	654.950.000	654.950.000	-	0,091%	-	Banks	99,797	FI
Allgemeine Sparkasse Oberoesterreich Bank AG	2,100%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	40.753.500	40.753.500	-	1,194%	-	Banks	100,000	AT
Allgemeine Sparkasse Oberoesterreich Bank AG	1,900%	22/10/2013	22/10/2018	EUR	6.424.928	6.424.928	-	1,351%	-	Banks	100,000	AT
Allianz Finance II BV	1,375%	13/03/2013	13/03/2018	EUR	648.530.000	648.530.000	-	0,238%	AA	Life Insurance	99,890	NL
AMATHEON AGRI	8,500%	04/04/2013	04/04/2018	EUR	12.876.600	12.876.600	-	7,922%	-	Food & Beverage	100,000	DE
Amplifon SpA	4,875%	16/07/2013	16/07/2018	EUR	361.449.000	361.449.000	-	1,972%	-	Supermarkets & Pharmacies	99,459	IT
ARGAN SA	5,500%	25/11/2013	25/11/2018	EUR	40.541.700	40.541.700	-	1,041%	-	Real Estate	100,000	FR
Art Investment Consulting GmbH	6,000%	30/04/2013	30/04/2018	EUR	13.158.200	13.158.200	-	5,039%	-	Consumer Services	100,000	AT
Assa Abloy AB	0,531%	23/10/2013	23/10/2018	EUR	41.366.100	41.366.100	41,52	0,393%	A-	Electrical Equipment Manufacturing	100,000	SE
ATON Group Finance GmbH	3,875%	08/11/2013	08/11/2018	EUR	267.338.000	267.338.000	-	2,676%	-	Financial Services	100,000	AT
Autonomous Community of Madrid Spain	5,750%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	1.413.622.760	1.413.622.760	-	0,595%	BBB	Government Local	99,683	ES
Banca Adria Credito Cooperativo Del Delta SC	1,000%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	20.507.100	20.507.100	-	1,355%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,750%	19/03/2013	19/03/2018	EUR	19.316.700	19.316.700	-	1,626%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,250%	19/03/2013	19/03/2018	EUR	12.877.800	12.877.800	-	1,631%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,250%	11/04/2013	11/04/2018	EUR	10.115.748	10.115.748	-	1,660%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	2,750%	16/05/2013	16/05/2018	EUR	16.121.875	16.121.875	-	1,650%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	3,000%	18/01/2013	18/01/2018	EUR	13.320.700	13.320.700	-	1,586%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	2,750%	22/08/2013	22/08/2018	EUR	16.697.750	16.697.750	-	1,712%	-	Banks	100,000	IT
Banca Agricola Popolare di Ragusa SCpA	2,750%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	101.438	16.906.250	-	1,866%	-	Banks	100,000	IT
Banca Alpi Marittime Credito Cooperativo di Carru SCARL	0,000%	04/11/2013	04/11/2018	EUR	2.199.542	6.755.350	-	1,907%	-	Banks	85,000	IT
Banca Apulia SpA	2,000%	18/03/2013	18/03/2018	EUR	9.070.670	9.070.670	377,19	3,820%	-	Banks	100,000	IT
Banca Apulia SpA	2,400%	18/02/2013	18/02/2018	EUR	6.676.700	6.676.700	-	3,887%	-	Banks	100,000	IT

Banca Atestina di Credito Cooperativo	3,500%	28/10/2013	28/10/2018	EUR	41.374	9.653.840	-	2,223%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carige SpA	3,875%	24/10/2013	24/10/2018	EUR	1.035.322.500	1.035.322.500	-	0,725%	-	Banks	99,466	IT
Banca Carige SpA	3,500%	24/01/2013	24/01/2018	EUR	86.350.061	86.350.061	-	1,633%	-	Banks	100,000	IT
Banca Carim Cassa di Risparmio di Rimini SpA	2,400%	04/11/2013	04/11/2018	EUR	23.439.713	33.776.750	877,70	8,825%	-	Banks	100,000	IT
Banca Centropadana Credito Cooperativo Societa Cooperativa	3,000%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	25.431.745	25.431.745	-	1,654%	-	Banks	100,000	IT
Banca Centropadana Credito Cooperativo Societa Cooperativa	3,000%	15/07/2013	15/07/2018	EUR	26.102.000	26.102.000	-	1,704%	-	Banks	100,000	IT
Banca Cremonese Credito Cooperativo	2,500%	15/07/2013	15/07/2018	EUR	13.051.000	13.051.000	-	3,477%	-	Banks	100,000	IT
Banca del Centroveneto Credito Cooperativo SC	3,100%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	26.107.400	26.107.400	-	3,374%	-	Banks	100,000	IT
Banca del Centroveneto Credito Cooperativo SC	3,000%	01/12/2013	01/12/2018	EUR	18.551.990	18.551.990	-	3,505%	-	Banks	100,000	IT
Banca del Chianti Fiorentino SCARL	1,486%	10/07/2013	10/07/2018	EUR	2.210.406	12.851.200	155,54	1,603%	-	Banks	100,000	IT
Banca del Chianti Fiorentino SCARL	3,500%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	13.671.400	13.671.400	-	1,502%	-	Banks	100,000	IT
Banca della Marca Credito Cooperativo SC	3,600%	21/03/2013	21/03/2018	EUR	32.281.250	32.281.250	-	3,393%	-	Banks	100,000	IT
Banca della Marca Credito Cooperativo SC	2,850%	23/09/2013	23/09/2018	EUR	27.029.200	27.029.200	-	3,538%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Ancona Credito Cooperativo Societa Cooperativa	3,750%	15/11/2013	15/11/2018	EUR	413.870	6.740.550	-	1,905%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Agrobresciano SC	3,750%	21/01/2013	21/01/2018	EUR	7.942.199	7.942.199	-	1,596%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Cernusco sul Naviglio SC	2,500%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	6.800.100	6.800.100	-	1,672%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Cernusco sul Naviglio SC	1,549%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	1.143.504	6.526.850	152,11	1,569%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo del Metauro SC	3,049%	08/01/2013	08/01/2018	EUR	2.944.626	2.944.626	302,90	3,077%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,750%	02/01/2013	02/01/2018	EUR	19.753.200	19.753.200	-	3,523%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,125%	01/03/2013	01/03/2018	EUR	12.502.349	15.650.760	-	3,538%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,500%	11/02/2013	11/02/2018	EUR	8.711.762	16.090.680	-	3,568%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,000%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	15.664.440	15.664.440	-	3,668%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,000%	01/11/2013	01/11/2018	EUR	33.738.750	33.738.750	-	3,691%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,438%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	15.683.280	15.683.280	-	3,637%	-	Banks	100,000	IT

Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,125%	03/06/2013	03/06/2018	EUR	12.891.173	15.700.200	-	3,644%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Alba Langhe e Roero SC	3,000%	02/09/2013	02/09/2018	EUR	15.833.640	15.833.640	-	3,723%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Calcio e di Covo Societa Cooperativa	2,500%	15/10/2013	15/10/2018	EUR	4.428.694	20.247.000	-	3,524%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Cambiano Castelfiorentino Firenze SCpA	3,400%	05/04/2013	05/04/2018	EUR	6.504.800	6.504.800	-	1,743%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carate Brianza Societa Cooperativa	2,250%	18/11/2013	18/11/2018	EUR	4.217.166	40.523.700	-	1,990%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carate Brianza Societa Cooperativa	1,061%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	130.694	13.069.400	184,42	1,892%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Caravaggio SC	3,250%	16/10/2013	16/10/2018	EUR	882.170	20.264.250	-	3,562%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carugate	2,400%	05/12/2013	05/12/2018	EUR	10.931.760	10.931.760	-	3,297%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carugate	2,500%	28/05/2013	28/05/2018	EUR	1.334.142	6.432.700	-	3,182%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carugate	2,700%	26/07/2013	26/07/2018	EUR	3.208.496	6.640.100	-	3,236%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carugate	2,900%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	6.410.800	6.410.800	-	3,115%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Carugate	2,500%	26/09/2013	26/09/2018	EUR	2.072.117	2.072.117	-	3,291%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Cherasco SC	2,000%	06/11/2013	06/11/2018	EUR	958.986	13.525.900	-	3,547%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Cherasco SC	2,500%	05/08/2013	05/08/2018	EUR	4.099.284	4.099.284	-	3,498%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Fornacette SCARL	3,250%	05/06/2013	05/06/2018	EUR	4.300.980	6.544.400	-	1,580%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Fornacette SCARL	2,900%	15/10/2013	15/10/2018	EUR	4.215.425	6.749.000	-	1,614%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Gradara SC	4,250%	10/01/2013	10/01/2018	EUR	8.226.566	8.226.566	-	3,537%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Manzano Udine SC	2,250%	15/11/2013	15/11/2018	EUR	6.739.202	6.740.550	-	1,711%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Pitigliano SC	3,250%	15/10/2013	15/10/2018	EUR	4.988.861	6.749.000	-	3,323%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Roma SC	3,750%	16/01/2013	16/01/2018	EUR	35.958.976	35.958.976	-	3,437%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Roma SC	3,250%	19/11/2013	19/11/2018	EUR	67.679.500	67.679.500	-	3,402%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Roma SC	3,500%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	64.726.593	64.726.593	-	3,364%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sala di Cesenatico SC	2,500%	04/11/2013	04/11/2018	EUR	5.531.281	6.755.350	318,95	3,238%	-	Banks	100,000	IT

Banca di Credito Cooperativo di Sant Elena Padova SC	3,000%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	5.132.715	6.526.850	-	3,203%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sant Elena Padova SC	3,250%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	1.486.816	6.526.850	-	3,226%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sant Elena Padova SC	3,000%	20/05/2013	20/05/2018	EUR	2.683.004	6.437.150	-	3,185%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sorisole e Lepreno SC	2,800%	30/05/2013	30/05/2018	EUR	2.397.818	9.132.060	-	3,326%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Sorisole e Lepreno SC	2,500%	07/10/2013	07/10/2018	EUR	9.502.360	9.502.360	-	3,387%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Spello e Bettona SC	3,250%	31/05/2013	31/05/2018	EUR	3.270.090	6.485.700	-	3,445%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Orobica di Bariano e Cologno Al Serio SCARL	2,250%	01/09/2013	15/08/2018	EUR	7.903.625	7.903.625	-	1,821%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Orobica di Bariano e Cologno Al Serio SCARL	2,250%	16/09/2013	16/09/2018	EUR	1.064.452	1.064.452	-	1,913%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Valdostana - Cooperative de Credit Valdotaine SC	1,226%	02/09/2013	02/09/2018	EUR	698.000	9.236.290	309,73	3,145%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Forli Credito Cooperativo SC	3,000%	07/10/2013	07/10/2018	EUR	4.286.922	4.286.922	184,03	1,888%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Pistoia Credito Cooperativo SC	2,300%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	3.951.355	6.526.850	343,55	3,484%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Pistoia Credito Cooperativo SC	2,309%	18/11/2013	18/11/2018	EUR	848.296	13.507.900	353,25	3,580%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Rimini Credito Cooperativo Scrl	3,500%	09/08/2013	09/08/2018	EUR	6.671.700	6.671.700	-	3,733%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Romano e S Caterina Credito Cooperativo SC	2,600%	01/11/2013	01/11/2018	EUR	340.087	6.747.750	-	3,303%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Sassari SpA	3,100%	08/03/2013	08/03/2018	EUR	11.493.287	19.484.550	-	1,729%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Sassari SpA	2,500%	10/06/2013	10/06/2018	EUR	3.831.069	13.233.400	-	1,828%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Udine Credito Cooperativo SC	3,500%	29/07/2013	29/07/2018	EUR	6.617.838	6.631.100	-	3,325%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Udine Credito Cooperativo SC	2,750%	11/11/2013	11/11/2018	EUR	6.701.300	6.701.300	-	3,343%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Udine Credito Cooperativo SC	2,250%	11/11/2013	11/11/2018	EUR	1.790.587	6.701.300	-	3,378%	-	Banks	100,000	IT
Banca IMI SpA	1,987%	30/05/2013	30/05/2018	EUR	64.302.748	64.302.748	143,61	1,414%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	1,085%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	19.922.202	38.464.800	129,85	1,277%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca Intermobiliare SpA	3,500%	26/07/2013	01/07/2018	EUR	25.086.298	32.855.215	-	2,417%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	3,000%	18/06/2013	18/06/2018	EUR	12.285.986	20.092.650	-	3,184%	-	Banks	100,000	IT
Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	1,600%	22/03/2013	22/03/2018	EUR	403.485	25.947.600	294,63	2,994%	-	Banks	100,000	IT

Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	3,500%	22/03/2013	22/03/2018	EUR	13.126.891	25.947.600	-	3,125%	-	Banks	100,000	IT
Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	2,750%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	30.582.864	41.034.300	-	3,227%	-	Banks	100,000	IT
Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	1,500%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	15.558.839	20.517.150	300,56	3,054%	-	Banks	100,000	IT
Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	1,600%	06/09/2013	06/09/2018	EUR	2.179.958	19.746.000	304,03	3,088%	-	Banks	100,000	IT
Banca Mediocredito del Friuli-Venezia Giulia SpA	2,700%	30/04/2013	30/04/2018	EUR	16.941.183	16.941.183	100,78	2,062%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,000%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	95.496.318	95.496.318	129,00	1,268%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,378%	31/07/2013	31/07/2018	EUR	33.137.146	33.137.146	142,72	1,405%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,000%	30/04/2013	30/04/2018	EUR	49.064.296	49.064.296	136,20	1,340%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,485%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	8.744.696	8.744.696	144,78	1,426%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,000%	31/10/2013	31/10/2018	EUR	88.394.150	88.394.150	-	1,529%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,285%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	25.643.200	25.643.200	134,92	1,327%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,000%	30/09/2013	30/09/2018	EUR	40.593.900	40.593.900	-	1,545%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	4,000%	30/08/2013	30/08/2018	EUR	39.612.600	39.612.600	-	1,536%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	1,085%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	5.852.340	26.010.400	144,32	1,421%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	2,000%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	18.896.474	18.896.474	142,07	1,399%	-	Banks	100,000	IT
Banca Picena Truentina Credito Cooperativo Societa Cooperativa	3,200%	24/06/2013	24/06/2018	EUR	1.309.620	6.548.100	-	3,358%	-	Banks	100,000	IT
Banca Picena Truentina Credito Cooperativo Societa Cooperativa	2,400%	11/12/2013	11/12/2018	EUR	6.901.250	6.901.250	-	3,432%	-	Banks	100,000	IT
Banca Picena Truentina Credito Cooperativo Societa Cooperativa	2,800%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	1.758.250	1.758.250	-	3,412%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Frusinate Societa Cooperativaper Azioni	3,500%	01/11/2013	01/11/2018	EUR	373.825	6.747.750	-	1,922%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Lazio Societa' Cooperativa per Azioni	2,750%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	7.841.330	7.841.330	-	3,321%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Del Mezzogiorno SpA	3,500%	15/04/2013	15/04/2018	EUR	6.206.063	6.535.450	-	3,426%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Alto Adige SCpA Suedtiroler Volksbank Genossenschaft auf Akt	2,200%	05/11/2013	05/11/2018	EUR	4.126.963	20.203.800	-	2,256%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Alto Adige SCpA Suedtiroler Volksbank Genossenschaft auf Akt	2,500%	03/07/2013	03/07/2018	EUR	1.699.511	13.013.100	-	2,252%	-	Banks	100,000	IT

Banca Popolare dell'Alto Adige SCpA Suedtiroler Volksbank Genossenschaft auf Akt	2,500%	23/01/2013	23/01/2018	EUR	282.117	13.307.400	-	2,205%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	3,375%	15/10/2013	22/10/2018	EUR	1.349.800.000	1.349.800.000	-	0,157%	-	Banks	99,618	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	2,650%	04/10/2013	04/10/2018	EUR	33.881.000	33.881.000	163,10	1,679%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Etruria e del Lazio SC	3,500%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	78.031.200	78.031.200	-	1,832%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Etruria e del Lazio SC	3,200%	30/10/2013	30/10/2018	EUR	64.555.606	64.555.606	-	1,902%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Etruria e del Lazio SC	3,600%	15/07/2013	15/07/2018	EUR	14.951.226	14.951.226	-	1,916%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Etruria e del Lazio SC	3,500%	03/09/2013	03/09/2018	EUR	27.301.263	27.301.263	-	1,911%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bari SCpA	3,250%	20/09/2013	20/09/2018	EUR	32.402.731	32.402.731	-	3,211%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Cividale SCPA	3,000%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	168.642	168.642	234,57	2,394%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	3,500%	31/10/2013	31/10/2018	EUR	407.973	407.973	268,95	2,739%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,250%	31/07/2013	31/07/2018	EUR	33.190.250	33.190.250	-	1,651%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,000%	27/12/2013	27/12/2018	EUR	48.189.050	48.189.050	-	1,695%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,100%	15/11/2013	15/11/2018	EUR	103.804.470	103.804.470	-	1,655%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,250%	31/10/2013	31/10/2018	EUR	20.398.650	20.398.650	-	1,702%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,150%	30/08/2013	30/08/2018	EUR	39.612.600	39.612.600	-	1,652%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,150%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	52.747.500	52.747.500	-	1,655%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	5,000%	25/10/2013	25/10/2018	EUR	551.792.000	551.792.000	-	3,946%	NR	Banks	99,461	IT
Banca Popolare di Vicenza	3,800%	24/04/2013	24/04/2018	EUR	2.601.240	2.601.240	-	4,055%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	4,760%	14/06/2013	14/06/2018	EUR	66.600.000	66.600.000	-	3,980%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Etica Scpa	2,500%	11/02/2013	11/02/2018	EUR	10.727.120	10.727.120	-	1,505%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Etica Scpa	2,250%	18/03/2013	18/03/2018	EUR	8.832.241	8.832.241	-	1,525%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,750%	07/01/2013	07/01/2018	EUR	7.901.623	19.662.300	-	3,177%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,200%	05/08/2013	05/08/2018	EUR	5.516.992	19.893.000	-	3,334%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,100%	08/07/2013	08/07/2018	EUR	5.506.003	19.301.250	-	3,327%	-	Banks	100,000	IT

Banca Popolare Pugliese Scpa	3,000%	08/07/2013	08/07/2018	EUR	3.444.630	19.301.250	-	3,317%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,300%	05/08/2013	05/08/2018	EUR	6.043.493	6.043.493	-	3,346%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,100%	07/06/2013	07/06/2018	EUR	8.386.461	19.832.400	-	3,288%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,000%	07/06/2013	07/06/2018	EUR	5.504.152	19.832.400	-	3,281%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,000%	09/12/2013	09/12/2018	EUR	10.635.403	20.584.650	-	3,382%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,900%	09/12/2013	09/12/2018	EUR	6.968.590	20.584.650	-	3,402%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,200%	07/11/2013	07/11/2018	EUR	6.806.957	20.107.200	-	3,390%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,100%	07/11/2013	07/11/2018	EUR	5.679.614	20.107.200	-	3,392%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,200%	07/10/2013	07/10/2018	EUR	5.029.463	20.362.200	-	3,370%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,300%	07/10/2013	07/10/2018	EUR	5.257.520	20.362.200	-	3,387%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,100%	09/09/2013	09/09/2018	EUR	4.347.331	4.347.331	-	3,359%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,750%	07/02/2013	07/02/2018	EUR	18.041.497	18.041.497	-	3,148%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,000%	09/09/2013	09/09/2018	EUR	4.291.647	4.291.647	-	3,366%	-	Banks	100,000	IT
Banca San Biagio del Veneto Orientale Banca di Credito Cooperativo SC	2,000%	07/10/2013	07/10/2018	EUR	1.441.644	6.787.400	-	1,985%	-	Banks	100,000	IT
Banca San Giorgio Quinto Valle Agno Credito Cooperativo	2,250%	20/08/2013	20/08/2018	EUR	477.756	13.420.100	-	3,306%	-	Banks	100,000	IT
Banca San Giorgio Quinto Valle Agno Credito Cooperativo	3,250%	20/06/2013	20/06/2018	EUR	2.664.950	13.238.700	-	3,248%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	3,500%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	12.506.750	12.506.750	-	1,794%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	4,250%	02/04/2013	02/04/2018	EUR	25.652.200	25.652.200	-	1,720%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	3,000%	02/12/2013	02/12/2018	EUR	238.489	27.101.000	-	1,940%	-	Banks	100,000	IT
Banca Versilia Lunigiana e Garfagnana - Credito Cooperativo SC	3,000%	01/03/2013	01/03/2018	EUR	7.428.894	16.954.990	-	3,125%	-	Banks	100,000	IT
Banco de Sabadell SA	3,375%	23/01/2013	23/01/2018	EUR	1.330.740.000	1.330.740.000	-	0,182%	-	Banks	99,508	ES
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,000%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	11.238.964	20.700.450	-	3,907%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,500%	27/09/2013	27/09/2018	EUR	27.045.000	27.045.000	-	3,784%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,750%	27/05/2013	27/05/2018	EUR	38.788.800	38.788.800	-	3,627%	-	Banks	100,000	IT

Banco di Desio e della Brianza SpA	2,500%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	22.566.186	22.566.186	-	3,757%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,250%	20/03/2013	20/03/2018	EUR	10.788.284	10.788.284	-	1,671%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,000%	06/12/2013	06/12/2018	EUR	10.599.489	10.599.489	-	3,882%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,550%	03/06/2013	03/06/2018	EUR	17.008.550	17.008.550	401,08	4,059%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,000%	15/07/2013	15/07/2018	EUR	19.576.500	19.576.500	-	1,697%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,500%	30/10/2013	30/10/2018	EUR	27.540.200	27.540.200	-	3,810%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,000%	16/04/2013	16/04/2018	EUR	13.173.500	13.173.500	-	1,676%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	3,250%	18/02/2013	18/02/2018	EUR	13.353.400	13.353.400	-	1,669%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,000%	25/11/2013	25/11/2018	EUR	9.324.591	20.270.850	-	3,906%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Lucca SpA	3,800%	21/06/2013	21/06/2018	EUR	197.126	13.141.700	-	3,601%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	3,200%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	29.776.309	29.776.309	-	1,532%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	2,800%	20/05/2013	20/05/2018	EUR	64.358.626	64.358.626	-	1,558%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	2,500%	08/08/2013	08/08/2018	EUR	31.757.231	31.757.231	-	1,636%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	2,500%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	33.812.500	33.812.500	-	1,657%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	4,000%	31/10/2013	31/10/2018	EUR	543.776.332	543.776.332	-	2,191%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	4,200%	02/09/2013	02/09/2018	EUR	794.817.061	794.817.061	-	2,133%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	4,300%	31/01/2013	06/01/2018	EUR	211.714.433	211.714.433	-	2,006%	NR	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	4,000%	30/07/2013	30/07/2018	EUR	538.381.628	538.381.628	-	2,100%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,381%	31/07/2013	20/07/2018	EUR	28.145.332	28.145.332	216,00	2,138%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,381%	31/01/2013	19/01/2018	EUR	127.286.765	127.286.765	199,44	1,972%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,381%	30/04/2013	20/04/2018	EUR	40.724.629	40.724.629	208,40	2,062%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	28/03/2013	15/03/2018	EUR	11.539.440	11.539.440	211,23	2,090%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	3,381%	31/01/2013	18/01/2018	EUR	44.964.695	44.964.695	203,82	2,016%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	31/05/2013	31/05/2018	EUR	62.243.263	62.243.263	-	2,202%	-	Banks	88,750	IT
Banco Popolare SC	0,000%	28/02/2013	28/02/2018	EUR	91.208.220	91.208.220	-	2,097%	-	Banks	87,750	IT

Banco Popolare SC	2,381%	17/07/2013	19/07/2018	EUR	53.214.165	53.214.165	213,30	2,111%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,381%	31/10/2013	18/10/2018	EUR	136.283.381	136.283.381	212,80	2,106%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,381%	30/04/2013	19/04/2018	EUR	7.763.338	7.763.338	215,40	2,132%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	28/03/2013	16/03/2018	EUR	57.056.120	57.056.120	204,51	2,023%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	0,000%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	117.552.112	117.552.112	-	2,062%	-	Banks	86,000	IT
Banco Popolare SC	2,381%	31/10/2013	19/10/2018	EUR	69.355.410	69.355.410	214,99	2,128%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	30/09/2013	20/09/2018	EUR	120.834.509	120.834.509	212,26	2,101%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,389%	29/11/2013	20/11/2018	EUR	56.447.753	56.447.753	216,72	2,145%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	30/09/2013	21/09/2018	EUR	22.461.958	22.461.958	218,22	2,160%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,589%	20/02/2013	20/02/2018	EUR	5.337.600	5.337.600	213,49	2,113%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	27/12/2013	20/12/2018	EUR	21.230.719	21.230.719	220,01	2,178%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	27/12/2013	19/12/2018	EUR	5.672.540	5.672.540	223,27	2,211%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	27/12/2013	21/12/2018	EUR	34.572.201	34.572.201	218,85	2,167%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,391%	29/11/2013	16/11/2018	EUR	40.688.573	40.688.573	220,45	2,182%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,390%	29/11/2013	19/11/2018	EUR	53.662.725	53.662.725	216,76	2,146%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,391%	31/05/2013	18/05/2018	EUR	111.164.898	111.164.898	206,06	2,039%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	28/06/2013	14/06/2018	EUR	52.020.800	52.020.800	211,07	2,089%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	28/06/2013	15/06/2018	EUR	41.876.744	41.876.744	212,05	2,099%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,991%	28/02/2013	15/02/2018	EUR	17.662.320	17.662.320	208,78	2,066%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,991%	28/02/2013	16/02/2018	EUR	32.184.672	32.184.672	206,28	2,041%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,386%	16/09/2013	21/09/2018	EUR	4.135.090	4.135.090	228,24	2,260%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,391%	30/08/2013	16/08/2018	EUR	51.100.254	51.100.254	214,09	2,119%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,391%	30/08/2013	17/08/2018	EUR	23.107.350	23.107.350	217,25	2,150%	-	Banks	100,000	IT
Banco Santander SA	2,875%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	2.714.740.000	2.714.740.000	-	0,123%	-	Diversified Banks	99,487	ES
Banimmo SA/NV	5,200%	30/05/2013	30/05/2018	EUR	44.449.650	44.449.650	-	3,676%	-	Real Estate	100,000	BE

Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	0,527%	03/05/2013	03/05/2018	EUR	3.932.040	3.932.040	54,98	0,528%	-	Banks	100,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	0,591%	16/05/2013	16/05/2018	EUR	32.243.750	32.243.750	22,38	0,202%	-	Banks	100,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	2,010%	26/09/2013	26/09/2018	EUR	17.514.640	17.514.640	-	1,232%	-	Banks	100,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	1,750%	12/07/2013	12/07/2018	EUR	13.075.700	13.075.700	-	1,204%	-	Banks	99,500	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	1,625%	10/10/2013	10/10/2018	EUR	13.522.300	13.522.300	-	1,215%	-	Banks	100,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	2,000%	09/01/2013	09/01/2018	EUR	13.069.000	13.069.000	-	1,130%	-	Banks	100,000	AT
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1,250%	29/10/2013	29/10/2018	EUR	1.374.510.000	1.374.510.000	-	0,038%	AA+	Government Development Banks	99,534	NL
Bank of Ireland Mortgage Bank	2,750%	22/03/2013	22/03/2018	EUR	648.690.000	648.690.000	-	0,285%	-	Banks	99,655	IE
Bankinter SA	3,125%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	801.456.000	801.456.000	-	0,211%	A	Banks	99,668	ES
Banque Federative du Credit Mutuel SA	1,625%	11/01/2013	11/01/2018	EUR	1.669.975.000	1.669.975.000	-	0,339%	A	Banks	99,881	FR
Banque Federative du Credit Mutuel SA	1,870%	09/10/2013	09/10/2018	EUR	135.114.000	135.114.000	-	1,214%	A	Banks	100,000	FR
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,500%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	13.678.100	13.678.100	-	0,775%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,700%	08/03/2013	08/03/2018	EUR	7.793.820	7.793.820	-	0,730%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,500%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	6.800.100	6.800.100	67,78	0,656%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,750%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	33.934.250	33.934.250	-	0,653%	-	Banks	100,000	LU
BASF SE	0,296%	13/03/2013	13/03/2018	EUR	389.118.000	389.118.000	26,21	0,240%	A+	Chemicals	100,000	DE
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	0,988%	02/12/2013	02/12/2018	EUR	4.065.150	4.065.150	154,17	1,520%	-	Banks	100,000	AT
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	1,206%	25/06/2013	25/06/2018	EUR	19.648.500	19.648.500	146,99	1,448%	-	Banks	100,000	AT
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	2,000%	13/02/2013	13/02/2018	EUR	33.631.500	33.631.500	-	1,225%	-	Banks	100,150	AT
Bayerische Landesbank	1,125%	23/12/2013	07/01/2019	EUR	273.986.000	273.986.000	-	0,209%	-	Banks	100,440	DE
Bayerische Landesbank	1,250%	20/06/2013	20/06/2018	EUR	264.774.000	264.774.000	-	0,538%	-	Banks	100,070	DE
Bayerische Landesbank	1,250%	27/08/2013	27/08/2018	EUR	267.756.000	267.756.000	-	0,189%	-	Banks	99,930	DE
Bayerische Landesbank	1,250%	17/12/2013	17/12/2018	EUR	275.112.000	275.112.000	-	0,692%	-	Banks	99,740	DE

Bayerische Landesbank	1,000%	28/11/2013	28/11/2018	EUR	271.918.000	271.918.000	-	0,189%	-	Banks	99,990	DE
Bayerische Landesbank	1,250%	16/04/2013	16/04/2018	EUR	263.470.000	263.470.000	-	0,469%	-	Banks	100,780	DE
Bayerische Landesbank	0,540%	05/07/2013	05/07/2018	EUR	128.325.000	128.325.000	63,24	0,610%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	0,251%	14/05/2013	14/05/2018	EUR	259.072.000	259.072.000	45,05	0,498%	-	Banks	99,950	DE
Bayerische Landesbank	0,250%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	260.104.000	260.104.000	45,58	0,504%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,000%	10/10/2013	10/10/2018	EUR	135.223.000	135.223.000	-	0,715%	-	Banks	100,000	DE
BBVA Senior Finance SAU	3,750%	17/01/2013	17/01/2018	EUR	2.004.585.000	2.004.585.000	-	0,527%	BBB	Banks	99,709	ES
BCC Pieve di Sacco SCRL	3,400%	01/03/2013	01/03/2018	EUR	7.664.960	13.042.300	-	3,189%	-	Banks	100,000	IT
BCC Staranzano e Villesse Soc Coop	3,000%	11/02/2013	11/02/2018	EUR	2.317.058	6.704.450	-	3,099%	-	Banks	100,000	IT
BCC Staranzano e Villesse Soc Coop	2,250%	12/08/2013	12/08/2018	EUR	3.992.250	9.315.250	-	3,221%	-	Banks	100,000	IT
Befimmo SA	2,812%	31/07/2013	31/07/2018	EUR	19.914.150	19.914.150	-	1,987%	-	Real Estate	100,000	BE
Belfius Bank SA/NV	2,250%	26/09/2013	26/09/2018	EUR	875.732.000	875.732.000	-	0,726%	A-	Banks	99,804	BE
Belfius Bank SA/NV	1,300%	12/03/2013	12/03/2018	EUR	11.395.038	11.395.038	68,72	0,665%	-	Banks	100,000	BE
Belfius Financing Co	1,600%	07/06/2013	07/06/2018	EUR	66.108.000	66.108.000	-	1,625%	-	Banks	100,000	LU
Belfius Financing Co	1,800%	06/12/2013	06/12/2018	EUR	205.443.000	205.443.000	-	1,619%	-	Banks	100,000	LU
Belfius Financing Co	1,600%	05/07/2013	05/07/2018	EUR	72.118.650	72.118.650	-	1,630%	-	Banks	100,000	LU
Belfius Financing Co	1,800%	04/10/2013	04/10/2018	EUR	203.286.000	203.286.000	-	1,597%	-	Banks	100,000	LU
Belfius Financing Co	2,000%	05/04/2013	05/04/2018	EUR	138.161.952	138.161.952	-	1,577%	-	Banks	100,000	LU
Belfius Financing Co	1,950%	07/11/2013	07/11/2018	EUR	201.072.000	201.072.000	-	1,611%	-	Banks	100,000	LU
Berlin Hyp AG	1,125%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	1.528.200.000	1.528.200.000	-	0,012%	-	Consumer Finance	99,865	DE
Berlin Hyp AG	1,125%	21/05/2013	21/05/2018	EUR	645.675.000	645.675.000	-	0,416%	-	Consumer Finance	99,641	DE
Berlin Hyp AG	1,150%	14/08/2013	14/08/2018	EUR	13.255.900	13.255.900	-	0,259%	-	Consumer Finance	99,800	DE
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	2,500%	02/12/2013	02/12/2018	EUR	7.569.309	33.876.250	-	1,932%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	2,250%	10/06/2013	10/06/2018	EUR	5.299.977	13.233.400	-	1,870%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	2,500%	15/04/2013	15/04/2018	EUR	6.599.497	6.599.497	-	1,826%	-	Banks	100,000	IT

Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	2,500%	25/02/2013	25/02/2018	EUR	16.458.838	16.458.838	-	1,755%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	2,500%	16/10/2013	16/10/2018	EUR	10.586.044	20.264.250	-	1,908%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	3,000%	02/09/2013	02/09/2018	EUR	6.745.131	19.792.050	-	1,921%	-	Banks	100,000	IT
BKS Bank AG	2,250%	07/03/2013	07/03/2018	EUR	26.194.800	26.194.800	-	1,262%	-	Banks	100,000	AT
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	1,100%	15/08/2013	15/08/2018	EUR	4.541.756	4.541.756	77,11	0,749%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	0,850%	08/11/2013	08/11/2018	EUR	66.834.500	66.834.500	64,26	0,621%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	1,000%	21/10/2013	22/10/2018	EUR	1.018.862	1.018.862	75,62	0,734%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	0,783%	07/02/2013	07/02/2018	EUR	3.082.184	3.082.184	77,49	0,701%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	0,900%	18/12/2013	18/12/2018	EUR	1.654.895	1.654.895	73,03	0,708%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	1,250%	05/09/2013	05/09/2018	EUR	6.706.789	6.706.789	74,68	0,725%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	1,150%	25/09/2013	25/09/2018	EUR	2.049.537	2.049.537	77,22	0,750%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	3,150%	14/06/2013	30/06/2018	EUR	66.600.000	66.600.000	-	2,100%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	1,300%	06/03/2013	06/03/2018	EUR	25.980.800	25.980.800	70,46	0,683%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	3,100%	20/03/2013	04/04/2018	EUR	64.709.000	64.709.000	-	2,074%	-	Banks	101,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	1,500%	06/03/2013	06/03/2018	EUR	25.980.800	25.980.800	-	0,770%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Home Loan SFH SA	1,229%	18/02/2013	22/02/2018	EUR	18.694.760	18.694.760	-	0,234%	AAA	Financial Services	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,691%	16/05/2013	16/05/2018	EUR	64.487.500	64.487.500	55,46	0,533%	A+	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,250%	17/10/2013	17/10/2018	EUR	1.707.800	1.707.800	77,08	0,749%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,400%	25/11/2013	25/11/2018	EUR	1.351.390	1.351.390	76,79	0,746%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,826%	20/09/2013	20/09/2018	EUR	23.671.375	23.671.375	63,03	0,608%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,500%	01/11/2013	01/11/2018	EUR	2.226.758	2.226.758	78,02	0,758%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,384%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	13.053.700	13.053.700	65,41	0,632%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BPCE SA	0,647%	28/05/2013	28/05/2018	EUR	1.344.434.300	1.344.434.300	30,09	0,279%	A	Banks	100,000	FR
BPCE SA	0,717%	10/09/2013	10/09/2018	EUR	198.900.000	198.900.000	41,58	0,394%	-	Banks	100,000	FR
BPCE SA	0,706%	12/09/2013	12/09/2018	EUR	266.212.000	266.212.000	39,06	0,369%	A	Banks	100,000	FR

BPCE SFH SA	0,437%	08/02/2013	02/02/2018	EUR	33.387.250	33.387.250	21,70	0,195%	AAA	Banks	100,000	FR
BPCE SFH SA	0,249%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	10.942.480	10.942.480	5,99	0,108%	AAA	Banks	100,000	FR
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,138%	22/05/2013	22/05/2018	EUR	128.670.000	128.670.000	9,88	0,077%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,375%	19/07/2013	19/07/2018	EUR	65.696.500	65.696.500	-	0,530%	-	Banks	99,770	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,000%	18/01/2013	18/01/2018	EUR	133.207.000	133.207.000	-	0,145%	-	Banks	100,190	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,351%	15/10/2013	15/10/2018	EUR	67.490.000	67.490.000	48,61	0,464%	-	Banks	99,950	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,500%	05/07/2013	05/07/2018	EUR	64.162.500	64.162.500	-	0,684%	-	Banks	99,520	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,340%	18/10/2013	18/10/2018	EUR	68.457.500	68.457.500	39,34	0,441%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,588%	05/04/2013	05/04/2018	EUR	65.048.000	65.048.000	37,22	0,420%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,138%	28/02/2012	28/02/2017	EUR	67.261.000	67.261.000	32,09	0,369%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,950%	05/03/2013	05/03/2018	EUR	65.127.000	65.127.000	-	0,183%	-	Banks	99,950	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,830%	08/01/2013	08/01/2018	EUR	130.698.000	130.698.000	-	0,140%	-	Banks	99,950	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,770%	06/05/2013	07/05/2018	EUR	65.376.000	65.376.000	-	0,188%	-	Banks	99,960	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,561%	07/05/2013	07/05/2018	EUR	65.419.000	65.419.000	37,75	0,425%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,250%	08/07/2013	06/07/2018	EUR	64.337.500	64.337.500	-	0,211%	-	Banks	99,990	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,525%	22/05/2013	22/05/2018	EUR	64.335.000	64.335.000	37,86	0,427%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,341%	14/11/2013	14/11/2018	EUR	67.359.000	67.359.000	39,43	0,442%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,900%	04/04/2013	04/04/2018	EUR	64.383.000	64.383.000	-	0,186%	-	Banks	99,960	DE
BRFkredit A/S	2,500%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	679.225.000	679.225.000	-	0,636%	A-	Consumer Finance	99,467	DK
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	0,086%	05/03/2013	05/03/2018	EUR	130.254.000	130.254.000	12,88	0,107%	-	Government Agencies	100,000	FR
Caisse des Depots et Consignations	0,118%	21/02/2013	21/02/2018	EUR	198.000.000	198.000.000	13,19	0,110%	AA	Government Agencies	100,000	FR
Caixa Geral de Depositos SA	3,750%	18/01/2013	18/01/2018	EUR	999.052.500	999.052.500	-	0,301%	-	Banks	99,620	PT
CaixaBank SA	3,125%	14/05/2013	14/05/2018	EUR	1.295.360.000	1.295.360.000	-	0,705%	BBB	Banks	99,708	ES
CaixaBank SA	3,000%	22/03/2013	22/03/2018	EUR	1.297.380.000	2.594.760.000	-	0,181%	A	Banks	99,858	ES
CaixaBank SA	3,964%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	407.211.000	407.211.000	-	0,647%	-	Banks	100,000	ES

CaixaBank SA	3,000%	07/06/2013	07/06/2018	EUR	1.718.808.000	1.718.808.000	-	0,158%	-	Banks	99,748	ES
Caja Rural de Granada S Coop de Credito	3,000%	16/12/2013	16/12/2018	EUR	824.760.000	824.760.000	-	0,292%	-	Banks	100,000	ES
Caja Rural de Navarra	2,875%	11/06/2013	11/06/2018	EUR	663.895.000	663.895.000	-	0,201%	-	Banks	99,624	ES
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	1,845%	04/11/2013	04/11/2018	EUR	8.781.955	8.781.955	352,93	3,507%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	1,995%	01/05/2013	01/05/2018	EUR	7.914.180	7.914.180	339,26	3,371%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige SpA	1,918%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	6.762.500	6.762.500	352,19	3,500%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Depositi e Prestiti SpA	3,010%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	134.385.000	134.385.000	-	0,772%	BBB-	Government Development Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti SpA	2,600%	25/11/2013	25/11/2018	EUR	801.374	20.270.850	-	3,946%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	0,490%	04/10/2013	04/10/2018	EUR	4.927.653	4.927.653	180,80	1,786%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	0,481%	15/01/2013	15/01/2018	EUR	19.553.111	19.553.111	164,74	1,625%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	2,500%	15/11/2013	15/11/2018	EUR	11.821.577	20.221.650	-	1,902%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	2,500%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	2.176.173	20.287.500	-	1,948%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	0,481%	25/07/2013	25/07/2018	EUR	4.536.156	33.072.000	180,27	1,781%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	3,000%	25/07/2013	25/07/2018	EUR	6.336.595	26.457.600	-	1,903%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	1,481%	25/07/2013	25/07/2018	EUR	453.748	33.072.000	189,73	1,875%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	2,500%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	13.264.275	20.400.300	-	1,905%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	2,500%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	6.544.971	27.356.200	-	1,929%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	0,491%	09/05/2013	09/05/2018	EUR	6.090.338	32.779.000	175,26	1,731%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	2,250%	31/05/2013	31/05/2018	EUR	3.345.324	19.457.100	-	1,874%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	0,487%	10/06/2013	10/06/2018	EUR	18.743.788	33.083.500	172,17	1,700%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	3,000%	15/01/2013	15/01/2018	EUR	12.840.272	20.002.500	-	1,744%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	3,000%	02/09/2013	02/09/2018	EUR	5.574.761	26.389.400	-	1,917%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Asti SpA	0,491%	15/02/2013	15/02/2018	EUR	8.056.287	8.056.287	170,30	1,681%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	3,250%	06/09/2013	06/09/2018	EUR	19.746.000	19.746.000	-	4,215%	-	Banks	101,000	IT

Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	2,299%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	4.905.561	4.905.561	412,13	4,169%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	1,984%	01/07/2013	29/06/2018	EUR	533.896	39.161.100	418,19	4,160%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	1,887%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	1.211.840	1.211.840	412,58	4,174%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	1,984%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	549.115	40.575.000	418,39	4,162%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	3,000%	31/05/2013	31/05/2018	EUR	5.188.560	5.188.560	-	4,241%	-	Banks	101,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	2,500%	02/04/2013	29/03/2018	EUR	5.058.614	5.058.614	387,76	3,926%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	1,986%	02/04/2013	29/03/2018	EUR	1.641.741	38.478.300	417,56	4,154%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bolzano SpA	1,986%	02/01/2013	02/01/2018	EUR	887.577	887.577	418,85	4,167%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bra SpA	1,049%	24/07/2013	24/07/2018	EUR	5.131.774	19.808.700	142,46	1,473%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bra SpA	3,100%	02/04/2013	02/04/2018	EUR	24.496.568	25.652.200	-	1,485%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Bra SpA	2,200%	04/11/2013	04/11/2018	EUR	9.934.418	20.266.050	-	1,604%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Cento SpA	3,600%	11/11/2013	11/11/2018	EUR	1.052.104	13.402.600	-	1,993%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ferrara SpA	4,000%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	31.997.812	31.997.812	-	1,835%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ferrara SpA	0,000%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	8.794.399	8.794.399	-	1,833%	-	Banks	80,230	IT
Cassa di Risparmio di Ferrara SpA	3,000%	04/02/2013	04/02/2018	EUR	8.494.692	8.494.692	-	1,809%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Parma e Piacenza SpA	1,628%	20/02/2013	20/02/2018	EUR	1.298.371	1.298.371	132,88	1,377%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ravenna SpA	2,000%	10/07/2013	10/07/2018	EUR	924.001	19.276.800	138,55	1,554%	-	Financial Services	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ravenna SpA	3,000%	11/02/2013	11/02/2018	EUR	11.134.751	11.134.751	-	1,494%	-	Financial Services	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Ravenna SpA	2,000%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	73.912	73.912	139,62	1,565%	-	Financial Services	100,000	IT
Cassa di Risparmio di San Miniato SpA	2,500%	16/12/2013	16/12/2018	EUR	1.164.286	27.492.000	-	1,824%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di San Miniato SpA	3,000%	15/04/2013	15/04/2018	EUR	2.974.937	19.606.350	-	1,716%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	3,000%	17/06/2013	17/06/2018	EUR	7.592.574	7.592.574	-	4,447%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	3,150%	15/04/2013	15/04/2018	EUR	7.251.735	7.251.735	-	4,432%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	3,250%	18/01/2013	18/01/2018	EUR	13.320.700	13.320.700	-	4,380%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	3,250%	28/01/2013	28/01/2018	EUR	6.729.100	6.729.100	-	4,420%	-	Banks	100,000	IT

Cassa di Risparmio di Volterra SpA	4,250%	24/12/2013	24/12/2018	EUR	13.682.200	13.682.200	-	4,478%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	4,500%	24/04/2013	24/04/2018	EUR	6.503.100	6.503.100	-	4,498%	-	Banks	100,000	IT
Cassa di Risparmio di Volterra SpA	3,000%	23/08/2013	23/08/2018	EUR	6.693.700	6.693.700	-	4,462%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Alta ValdiSole e Pejo BCC SC	2,100%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	969.694	6.800.100	204,19	2,090%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Banca di Credito Cooperativo di Treviglio SC	3,000%	20/05/2013	20/05/2018	EUR	14.464.276	14.464.276	-	2,195%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Aldeno e Cadine Banca di Credito Cooperativo SC	3,400%	04/02/2013	04/02/2018	EUR	20.302.800	20.302.800	-	1,722%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Fiemme Banca di Credito Cooperativo SC	3,250%	15/02/2013	15/02/2018	EUR	6.676.850	6.676.850	-	3,172%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Fiemme Banca di Credito Cooperativo SC	3,250%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	17.772.820	17.772.820	-	3,119%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Lizzana Banca di Credito Cooperativo SCARL	2,500%	15/05/2013	15/05/2018	EUR	5.431.031	9.002.420	-	3,215%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Pergine - BCC Soc Coop	3,000%	02/01/2013	02/01/2018	EUR	6.584.400	6.584.400	-	1,647%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Tuenno-Val di Non Banca di Credito Cooperativo SC	2,400%	21/10/2013	21/10/2018	EUR	6.836.632	6.838.000	-	1,903%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana Banca di Credito Cooperativo di Battipaglia SC	3,800%	10/12/2013	10/12/2018	EUR	11.015.600	11.015.600	-	2,104%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana Banca di Credito Cooperativo di Battipaglia SC	4,000%	15/10/2013	15/10/2018	EUR	6.749.000	6.749.000	-	2,118%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	2,500%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	6.773.291	19.820.400	-	3,289%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	3,000%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	13.620.816	13.671.400	-	3,102%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Cantu'Banca di Credito Cooperativo SC	2,500%	03/06/2013	03/06/2018	EUR	19.625.250	19.625.250	-	1,757%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Cantu'Banca di Credito Cooperativo SC	2,750%	21/01/2013	21/01/2018	EUR	19.975.350	19.975.350	-	1,672%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Cortina d'Ampezzo e delle Dolomiti Credito Cooperat	0,950%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	8.764.581	9.249.520	334,92	3,397%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Lavis-Valle di Cembra Banca Credito Cooperativo SC	2,750%	15/03/2013	15/03/2018	EUR	19.587.150	19.587.150	-	3,147%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Lavis-Valle di Cembra Banca Credito Cooperativo SC	2,250%	02/09/2013	02/09/2018	EUR	19.792.050	19.792.050	-	3,268%	-	Banks	100,000	IT
Cie de Financement Foncier SA	0,395%	27/03/2013	27/03/2018	EUR	63.860.000	63.860.000	18,18	0,160%	AAA	Consumer Finance	100,000	FR

Cie Immobiliere de Belgique SA	5,500%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	76.929.600	76.929.600	-	3,132%	-	Real Estate	100,000	BE
Commerzbank AG	1,500%	28/02/2013	28/02/2018	EUR	654.160.000	654.160.000	-	0,184%	-	Banks	99,776	DE
Commerzbank AG	1,000%	25/06/2013	25/06/2018	EUR	654.950.000	654.950.000	-	0,007%	-	Banks	99,666	DE
Commerzbank AG	0,844%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	54.296.000	54.296.000	59,22	0,570%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,791%	12/11/2013	12/11/2018	EUR	13.442.300	13.442.300	62,78	0,606%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	1,410%	10/04/2013	10/04/2018	EUR	6.530.800	6.530.800	-	0,717%	BBB+	Banks	99,976	DE
Commerzbank AG	0,591%	12/02/2013	12/02/2018	EUR	6.731.400	6.731.400	64,82	0,626%	BBB+	Banks	100,000	DE
Constantin Medien AG	7,000%	23/04/2013	23/04/2018	EUR	84.568.250	84.568.250	-	4,545%	-	Entertainment Content	100,000	DE
Continental AG	3,000%	16/07/2013	16/07/2018	EUR	985.770.000	985.770.000	-	0,501%	BBB	Auto Parts Manufacturing	98,950	DE
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands	0,286%	03/07/2013	03/07/2018	EUR	6.506.550	6.506.550	59,50	0,573%	A+	Banks	100,000	NL
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	1,950%	24/09/2013	24/09/2018	EUR	1.349.330	1.349.330	-	0,885%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole CIB Finance Guernsey Ltd	1,250%	21/08/2013	21/08/2018	EUR	1.203.633	1.203.633	74,84	0,726%	-	Banks	100,000	GG
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,750%	22/10/2013	22/10/2018	EUR	2.068.110	2.068.110	-	1,190%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,100%	21/10/2013	21/10/2018	EUR	820.560	820.560	119,18	1,170%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,000%	15/11/2013	15/11/2018	EUR	4.044.330	4.044.330	114,08	1,119%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,200%	04/03/2013	04/03/2018	EUR	1.300.950	1.300.950	113,56	1,114%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole SA/London	1,750%	12/03/2013	12/03/2018	EUR	1.302.290.000	1.302.290.000	-	0,359%	A	Diversified Banks	99,953	GB
Credit Agricole SA/London	0,831%	18/07/2013	18/07/2018	EUR	327.117.500	327.117.500	38,60	0,364%	A	Diversified Banks	100,000	GB
Credit Agricole SA/London	1,960%	02/10/2013	02/10/2018	EUR	135.830.000	135.830.000	-	0,639%	A	Diversified Banks	100,000	GB
Credit du Nord SA	0,988%	26/02/2013	26/02/2018	EUR	652.625.000	652.625.000	73,16	0,710%	-	Banks	100,000	FR
Credito Bergamasco SpA	0,000%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	7.034.054	7.034.054	-	2,417%	-	Banks	86,000	IT
Credito Bergamasco SpA	0,000%	31/05/2013	31/05/2018	EUR	5.292.331	5.292.331	-	2,538%	-	Banks	88,750	IT
Credito Bergamasco SpA	0,000%	15/03/2013	15/03/2018	EUR	2.867.559	2.867.559	-	2,493%	-	Banks	87,750	IT
Credito Bergamasco SpA	0,000%	30/04/2013	30/04/2018	EUR	4.056.673	4.056.673	-	2,521%	-	Banks	88,350	IT

Credito Bergamasco SpA	0,000%	28/02/2013	28/02/2018	EUR	3.408.174	3.408.174	-	2,471%	-	Banks	87,750	IT
Credito Cooperativo di Brescia SC	3,000%	16/09/2013	10/09/2018	EUR	28.820.243	28.820.243	-	1,730%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo di Brescia SC	3,250%	10/01/2013	10/01/2018	EUR	8.168.222	8.168.222	-	1,637%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Interprovinciale Veneto SCARL	4,000%	25/03/2013	25/03/2018	EUR	12.878.500	12.878.500	-	3,090%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Interprovinciale Veneto SCARL	2,500%	23/09/2013	23/09/2018	EUR	27.029.200	27.029.200	-	3,183%	-	Banks	100,000	IT
Credito Emiliano SpA	3,100%	15/10/2013	15/10/2018	EUR	269.960.000	269.960.000	-	1,422%	-	Banks	100,000	IT
Credito Siciliano SpA	3,750%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	13.800.300	13.800.300	-	3,922%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	3,750%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	234.605.100	234.605.100	-	3,383%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	2,850%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	44.740.573	44.740.573	-	3,424%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	3,150%	07/10/2013	07/10/2018	EUR	32.579.520	40.724.400	-	3,404%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	3,200%	22/01/2013	22/01/2018	EUR	3.101.605	3.101.605	-	3,279%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	3,300%	30/04/2013	30/04/2018	EUR	39.474.600	39.474.600	-	3,252%	-	Banks	100,000	IT
Daimler AG	1,500%	19/11/2013	19/11/2018	EUR	1.353.590.000	1.353.590.000	-	0,342%	A-	Automobiles Manufacturing	99,756	DE
Danske Bank A/S	0,886%	19/03/2013	19/03/2018	EUR	12.877.800	12.877.800	48,01	0,458%	-	Banks	100,000	DK
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,291%	17/04/2013	17/04/2018	EUR	26.049.000	26.049.000	62,49	0,603%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,292%	09/07/2013	09/07/2018	EUR	57.562.650	57.562.650	57,51	0,553%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,250%	25/06/2013	25/06/2018	EUR	26.198.000	26.198.000	-	0,710%	-	Banks	100,220	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,367%	28/02/2013	28/02/2018	EUR	13.083.200	13.083.200	66,45	0,642%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,840%	05/03/2013	23/03/2018	EUR	5.210.160	5.210.160	-	0,967%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,323%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	33.934.250	33.934.250	43,80	0,607%	A	Banks	100,180	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,308%	19/02/2013	19/02/2018	EUR	40.165.500	40.165.500	42,52	0,594%	A	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,686%	31/05/2013	25/06/2018	EUR	5.188.560	5.188.560	96,90	0,947%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,400%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	20.507.100	20.507.100	-	0,723%	-	Banks	100,220	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,050%	29/05/2013	25/06/2018	EUR	32.339.750	32.339.750	-	1,504%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,900%	29/05/2013	25/06/2018	EUR	32.339.750	32.339.750	-	0,815%	-	Banks	100,000	DE

DekaBank Deutsche Girozentrale	1,150%	05/06/2013	25/06/2018	EUR	32.722.000	32.722.000	-	0,638%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,450%	23/12/2013	28/12/2018	EUR	13.699.300	13.699.300	-	1,020%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,050%	30/12/2013	28/12/2018	EUR	34.500.750	34.500.750	-	1,038%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,400%	05/12/2013	28/12/2018	EUR	13.664.700	13.664.700	-	1,037%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,500%	02/07/2013	02/07/2018	EUR	13.019.400	13.019.400	-	0,747%	-	Banks	99,750	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,500%	06/03/2013	23/03/2018	EUR	32.476.000	32.476.000	-	0,601%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,380%	18/03/2013	27/03/2018	EUR	5.183.240	5.183.240	-	1,789%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,850%	18/03/2013	27/03/2018	EUR	5.183.240	5.183.240	-	0,781%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	3,460%	20/03/2013	23/03/2018	EUR	5.176.720	5.176.720	-	0,862%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	3,180%	20/03/2013	23/03/2018	EUR	5.176.720	5.176.720	-	0,952%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,700%	26/03/2013	23/03/2018	EUR	12.854.000	12.854.000	112,08	1,169%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,580%	07/03/2013	23/03/2018	EUR	5.238.960	5.238.960	-	1,783%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,500%	06/03/2013	23/03/2018	EUR	32.476.000	32.476.000	-	1,465%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,360%	12/03/2013	23/03/2018	EUR	5.209.160	5.209.160	-	0,827%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,200%	26/02/2013	23/03/2018	EUR	5.221.000	5.221.000	-	0,389%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,800%	21/08/2013	25/09/2018	EUR	13.373.700	13.373.700	-	0,675%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,816%	21/08/2013	25/09/2018	EUR	13.373.700	13.373.700	73,33	0,711%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,000%	23/09/2013	25/09/2018	EUR	33.786.500	33.786.500	-	1,188%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,820%	28/08/2013	25/09/2018	EUR	13.333.200	13.333.200	-	1,298%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	4,200%	03/09/2013	25/09/2018	EUR	13.171.200	13.171.200	-	1,525%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,780%	17/09/2013	25/09/2018	EUR	13.354.600	13.354.600	-	0,870%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,926%	17/09/2013	25/09/2018	EUR	13.354.600	13.354.600	73,22	0,710%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,500%	02/10/2013	25/09/2018	EUR	13.583.000	13.583.000	-	0,623%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,580%	17/09/2013	25/09/2018	EUR	13.354.600	13.354.600	-	0,836%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,310%	17/09/2013	25/09/2018	EUR	13.354.600	13.354.600	-	0,756%	-	Banks	100,000	DE

DekaBank Deutsche Girozentrale	2,800%	18/09/2013	25/09/2018	EUR	10.686.480	10.686.480	-	1,117%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,200%	17/09/2013	25/09/2018	EUR	13.354.600	13.354.600	-	0,841%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,000%	04/12/2013	28/12/2018	EUR	33.986.000	33.986.000	-	1,040%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,125%	24/05/2013	24/05/2018	EUR	28.422.240	28.422.240	-	0,701%	-	Banks	101,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,700%	19/06/2013	19/06/2018	EUR	33.505	33.505	-	0,843%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,375%	18/06/2013	18/06/2018	EUR	33.487.750	33.487.750	-	0,704%	-	Banks	100,183	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,500%	29/10/2013	29/10/2018	EUR	54.980.400	54.980.400	-	0,664%	A	Banks	100,690	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,200%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	20.360.550	20.360.550	-	0,717%	-	Banks	100,080	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,308%	19/02/2013	19/02/2018	EUR	40.165.500	40.165.500	42,55	0,594%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,357%	19/02/2013	19/02/2018	EUR	13.388.500	13.388.500	57,73	0,625%	-	Banks	100,000	DE
Deutsche Apotheker-und Aerztebank eG	0,141%	14/08/2013	14/08/2018	EUR	33.139.750	33.139.750	2,63	0,004%	AAA	Banks	100,000	DE
Deutsche Apotheker-und Aerztebank eG	1,500%	13/08/2013	13/08/2018	EUR	13.252.800	13.252.800	-	0,597%	AA-	Banks	100,500	DE
Deutsche Apotheker-und Aerztebank eG	0,900%	19/04/2013	19/04/2018	EUR	9.147.320	9.147.320	-	0,249%	AAA	Banks	99,920	DE
Deutsche Bank AG/London	0,431%	25/01/2013	25/01/2018	EUR	134.515.000	134.515.000	88,34	0,861%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Boerse AG	1,125%	26/03/2013	26/03/2018	EUR	771.240.000	771.240.000	-	0,219%	AA /*-	Financial Services	99,331	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	0,076%	19/06/2013	19/06/2018	EUR	13.402.000	13.402.000	16,10	0,139%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	1,100%	15/05/2013	15/05/2018	EUR	12.860.600	12.860.600	-	0,927%	A+	Consumer Finance	101,500	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	1,190%	05/07/2013	05/07/2018	EUR	12.832.500	12.832.500	-	0,218%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	0,960%	07/06/2013	07/06/2018	EUR	13.221.600	13.221.600	-	0,208%	AAA	Consumer Finance	99,950	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	0,875%	22/01/2013	24/01/2018	EUR	997.942.500	997.942.500	-	0,003%	-	Consumer Finance	99,509	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,250%	13/08/2013	13/08/2018	EUR	33.132.000	33.132.000	-	0,108%	-	Consumer Finance	100,380	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,250%	04/07/2013	04/07/2018	EUR	32.304.750	32.304.750	-	0,167%	-	Consumer Finance	99,870	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,375%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	13.600.200	13.600.200	-	0,661%	-	Consumer Finance	100,035	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,500%	11/09/2013	11/09/2018	EUR	26.602.600	26.602.600	-	0,183%	-	Consumer Finance	100,403	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,250%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	40.575.000	40.575.000	-	0,157%	-	Consumer Finance	99,820	DE

Deutsche Kreditbank AG	1,000%	25/01/2013	25/01/2018	EUR	672.575.000	672.575.000	-	0,013%	-	Banks	99,632	DE
Deutsche Kreditbank AG	1,150%	06/08/2013	06/08/2018	EUR	39.895.800	39.895.800	-	0,181%	-	Banks	100,000	DE
Deutsche Kreditbank AG	1,220%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	13.574.000	13.574.000	-	0,205%	-	Banks	100,000	DE
Deutsche Kreditbank AG	1,100%	08/11/2013	08/11/2018	EUR	13.366.900	13.366.900	-	0,191%	-	Banks	99,950	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,375%	28/08/2013	28/08/2018	EUR	666.660.000	666.660.000	-	0,035%	AA+	Banks	99,803	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	2,000%	28/08/2013	28/08/2018	EUR	13.333.200	13.333.200	-	1,741%	BBB	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,730%	24/05/2013	24/05/2018	EUR	38.757.600	38.757.600	-	1,662%	BBB	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	2,130%	23/12/2013	27/12/2018	EUR	13.699.300	13.699.300	-	1,735%	BBB	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,375%	28/08/2013	28/08/2018	EUR	6.666.600	6.666.600	-	0,041%	AA+	Banks	99,920	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,320%	04/02/2013	05/02/2018	EUR	6.767.600	6.767.600	-	0,008%	AA+	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,320%	07/08/2013	07/08/2018	EUR	13.327.700	13.327.700	-	0,036%	AA+	Banks	100,000	DE
Deutsche Post AG	1,500%	09/10/2013	09/10/2018	EUR	675.570.000	675.570.000	-	0,392%	-	Transportation & Logistics	99,205	DE
Deutsche Rohstoff AG	8,000%	11/07/2013	11/07/2018	EUR	130.220.000	130.220.000	-	4,639%	-	Metals & Mining	100,000	DE
Dexia Credit Local SA	1,625%	29/10/2013	29/10/2018	EUR	2.749.020.000	2.749.020.000	-	0,201%	AA	Banks	99,948	FR
DIC Asset AG	5,750%	09/07/2013	09/07/2018	EUR	127.917.000	127.917.000	-	3,146%	-	Real Estate	100,000	DE
DNA Ltd	2,625%	28/11/2013	28/11/2018	EUR	135.959.000	135.959.000	-	1,333%	-	Wireline Telecommunications Services	99,701	FI
DNB Bank ASA	0,465%	04/04/2013	04/04/2018	EUR	64.383.000	64.383.000	47,28	0,451%	-	Banks	100,000	NO
DNB Bank ASA	0,514%	22/10/2013	22/10/2018	EUR	34.468.500	34.468.500	42,82	0,476%	A+	Banks	100,000	NO
DNB Bank ASA	1,430%	17/07/2013	17/07/2018	EUR	13.139.300	13.139.300	-	0,679%	A+	Banks	100,000	NO
DNB Bank ASA	1,598%	23/08/2013	23/08/2018	EUR	13.387.400	13.387.400	-	0,682%	A+	Banks	99,800	NO
DNB Bank ASA	1,125%	14/05/2013	14/05/2018	EUR	6.476.800	6.476.800	-	0,674%	-	Banks	100,000	NO
DNB Boligkreditt AS	1,000%	22/01/2013	22/01/2018	EUR	1.995.885.000	1.995.885.000	-	0,067%	AAA	Banks	99,588	NO
DNB Boligkreditt AS	1,125%	12/11/2013	12/11/2018	EUR	2.016.345.000	2.016.345.000	-	0,176%	AAA	Banks	99,672	NO
DNB Boligkreditt AS	0,130%	29/01/2014	29/01/2019	EUR	1.365.990.000	1.365.990.000	6,01	0,038%	AAA	Banks	99,850	NO

DNB Boligkreditt AS	0,132%	10/04/2013	10/04/2018	EUR	219.434.880	219.434.880	5,90	0,037%	AAA	Banks	99,749	NO
DNB Boligkreditt AS	0,840%	22/05/2013	22/05/2018	EUR	12.867.000	12.867.000	-	0,358%	AAA	Banks	100,000	NO
DNB Boligkreditt AS	1,180%	10/07/2013	10/07/2018	EUR	6.425.600	6.425.600	-	0,407%	AAA	Banks	100,000	NO
DSB	1,750%	05/07/2013	05/07/2018	EUR	38.497.500	38.497.500	-	1,155%	-	Railroad	100,000	DK
Duesseldorfer Hypothekenbank AG	1,500%	10/09/2013	10/09/2018	EUR	6.630.000	6.630.000	-	0,290%	-	Consumer Finance	99,120	DE
DVB Bank SE	1,625%	28/05/2013	28/05/2018	EUR	643.270.000	643.270.000	-	0,663%	A+	Commercial Finance	99,905	DE
DVB Bank SE	2,000%	25/01/2013	25/01/2018	EUR	67.257.500	67.257.500	-	0,664%	A+	Commercial Finance	99,830	DE
DVB Bank SE	2,125%	30/08/2013	30/08/2018	EUR	33.010.500	33.010.500	-	0,284%	-	Commercial Finance	100,000	DE
DVB Bank SE	1,750%	06/09/2013	06/09/2018	EUR	65.820.000	65.820.000	-	0,414%	-	Commercial Finance	99,500	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	4,875%	20/02/2013	23/03/2018	EUR	66.720.000	66.720.000	-	1,685%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,996%	21/02/2013	23/03/2018	EUR	66.000.000	66.000.000	42,97	0,408%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,036%	14/06/2013	25/06/2018	EUR	66.600.000	66.600.000	48,93	0,467%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,980%	19/06/2013	25/06/2018	EUR	67.010.000	67.010.000	-	0,160%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,146%	13/06/2013	25/06/2018	EUR	66.632.500	66.632.500	44,20	0,420%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,796%	11/06/2013	25/06/2018	EUR	66.389.500	66.389.500	37,69	0,355%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,956%	11/06/2013	25/06/2018	EUR	66.389.500	66.389.500	8,57	0,064%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,610%	22/05/2013	25/06/2018	EUR	64.335.000	64.335.000	-	0,411%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,550%	19/06/2013	25/06/2018	EUR	67.010.000	67.010.000	-	0,173%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,650%	19/06/2013	25/06/2018	EUR	67.010.000	67.010.000	-	0,325%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,450%	09/12/2013	28/12/2018	EUR	20.584.650	20.584.650	-	0,470%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,150%	11/07/2013	15/08/2018	EUR	26.044.000	26.044.000	-	0,491%	-	Banks	100,100	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,100%	18/07/2013	18/07/2018	EUR	13.084.700	13.084.700	-	0,249%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,000%	22/03/2013	22/03/2018	EUR	97.303.500	97.303.500	-	0,147%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,986%	22/02/2013	23/03/2018	EUR	65.952.000	65.952.000	22,30	0,201%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,910%	20/02/2013	23/03/2018	EUR	66.720.000	66.720.000	-	0,386%	-	Banks	100,000	DE

DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,576%	19/02/2013	23/03/2018	EUR	66.942.500	66.942.500	6,89	0,047%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,646%	19/02/2013	23/03/2018	EUR	66.942.500	66.942.500	2,35	0,001%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,576%	19/02/2013	23/03/2018	EUR	66.942.500	66.942.500	6,89	0,047%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,046%	19/02/2013	23/03/2018	EUR	66.942.500	66.942.500	22,31	0,201%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,526%	19/02/2013	23/03/2018	EUR	66.942.500	66.942.500	3,41	0,012%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,716%	14/03/2013	23/03/2018	EUR	65.042.000	65.042.000	9,28	0,071%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,886%	14/03/2013	23/03/2018	EUR	65.042.000	65.042.000	5,48	0,033%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,556%	07/03/2013	23/03/2018	EUR	65.487.000	65.487.000	4,95	0,028%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,220%	21/02/2013	23/03/2018	EUR	66.000.000	66.000.000	-	1,694%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,736%	26/08/2013	25/09/2018	EUR	66.837.500	66.837.500	29,51	0,273%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,100%	17/09/2013	25/09/2018	EUR	66.773.000	66.773.000	-	0,216%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,850%	16/09/2013	25/09/2018	EUR	33.347.500	33.347.500	-	0,636%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	2,050%	17/09/2013	25/09/2018	EUR	33.386.500	33.386.500	-	0,377%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,159%	13/03/2013	13/03/2018	EUR	25.941.200	25.941.200	6,50	0,113%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,250%	04/10/2013	04/10/2018	EUR	13.552.400	13.552.400	-	0,501%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,250%	26/09/2013	26/09/2018	EUR	33.682.000	33.682.000	-	0,205%	AA+	Banks	100,000	DE
DZ Privatbank SA	0,287%	28/11/2013	28/11/2018	EUR	33.989.750	33.989.750	40,75	0,386%	-	Banks	100,000	LU
Ei Towers SpA	3,875%	26/04/2013	26/04/2018	EUR	299.446.200	299.446.200	-	1,150%	-	Industrial Other	99,444	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	3,600%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	19.604.100	19.604.100	-	1,692%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	3,000%	12/08/2013	12/08/2018	EUR	19.961.250	19.961.250	-	1,742%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	3,400%	20/06/2013	20/06/2018	EUR	5.347.111	13.238.700	-	1,779%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	2,650%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	20.157.750	20.157.750	-	1,775%	-	Banks	100,000	IT
Erste Group Bank AG	1,750%	31/10/2013	31/10/2018	EUR	31.821.894	31.821.894	-	1,030%	-	Banks	100,500	AT
Erste Group Bank AG	0,082%	11/10/2013	11/10/2018	EUR	81.234.000	81.234.000	6,87	0,047%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,500%	13/03/2013	13/03/2018	EUR	6.682.453	6.682.453	-	1,014%	-	Banks	100,000	AT

Erste Group Bank AG	1,800%	12/02/2013	12/02/2018	EUR	3.365.700	3.365.700	-	1,040%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	0,639%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	1.282.160	1.282.160	92,21	0,970%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,300%	20/08/2013	20/08/2018	EUR	24.156.180	24.156.180	-	1,022%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,523%	06/02/2013	06/02/2018	EUR	6.756.900	6.756.900	153,04	1,508%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,200%	30/01/2013	20/01/2018	EUR	2.375.398	2.375.398	-	1,361%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,100%	23/10/2013	20/10/2018	EUR	3.102.458	3.102.458	-	1,674%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,250%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	2.346.051	2.346.051	-	1,094%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,250%	28/08/2013	28/08/2018	EUR	3.753.296	3.753.296	-	1,096%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,350%	04/01/2013	04/01/2018	EUR	2.870.802	2.870.802	-	1,014%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,500%	05/08/2013	05/08/2018	EUR	1.326.200	1.326.200	-	1,149%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,450%	30/10/2013	30/10/2018	EUR	2.547.469	2.547.469	-	1,106%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,350%	16/05/2013	16/05/2018	EUR	4.790.132	4.790.132	-	1,055%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,500%	20/03/2013	20/04/2018	EUR	323.545	323.545	-	1,057%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,750%	20/03/2013	20/04/2018	EUR	2.588.360	2.588.360	-	1,112%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	3,000%	27/09/2013	20/10/2018	EUR	1.352.250	1.352.250	-	2,998%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,550%	23/10/2013	20/10/2018	EUR	2.413.023	2.413.023	-	1,354%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,300%	04/12/2013	04/12/2018	EUR	2.922.796	2.922.796	-	1,093%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,200%	19/06/2013	19/06/2018	EUR	2.613.390	2.613.390	-	1,096%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,400%	27/11/2013	27/11/2018	EUR	2.549.859	2.549.859	-	1,099%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,650%	02/10/2013	02/10/2018	EUR	1.036.383	1.036.383	-	1,146%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,930%	02/10/2013	02/10/2018	EUR	8.149.800	8.149.800	-	1,079%	-	Banks	100,000	AT
Eurofins Scientific SE	3,125%	26/11/2013	26/11/2018	EUR	406.701.000	406.701.000	-	1,843%	-	Consumer Services	99,432	LU
F van Lanschot Bankiers NV	3,125%	05/06/2013	05/06/2018	EUR	654.440.000	654.440.000	-	0,978%	BBB+	Banks	100,000	NL
FADE - Fondo de Amortización del Deficit Electrico	3,875%	21/03/2013	17/03/2018	EUR	2.356.531.250	2.356.531.250	-	0,469%	BBB	Government Agencies	99,800	ES
FCA Capital Ireland PLC	4,000%	17/10/2013	17/10/2018	EUR	1.024.680.000	1.024.680.000	-	1,195%	BB+	Automobiles Manufacturing	99,707	IE

FCE Bank PLC	1,750%	21/05/2013	21/05/2018	EUR	645.675.000	645.675.000	-	0,754%	BBB	Automobiles Manufacturing	99,456	GB
Ferratum Capital Germany GmbH	8,000%	21/10/2013	21/10/2018	EUR	34.190.000	34.190.000	-	4,330%	-	Financial Services	100,000	DE
Ferrovial Emisiones SA	3,375%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	678.685.000	678.685.000	-	0,644%	BBB	Industrial Other	99,692	ES
Fiat Chrysler Finance Europe	6,625%	15/03/2013	15/03/2018	EUR	1.632.262.500	1.632.262.500	-	2,676%	BB-	Automobiles Manufacturing	100,000	LU
Fincantieri SpA	3,750%	19/11/2013	19/11/2018	EUR	406.077.000	406.077.000	-	2,574%	-	Transportation & Logistics	99,442	IT
Finnair OYJ	5,000%	29/08/2013	29/08/2018	EUR	198.594.000	198.594.000	-	2,967%	-	Airlines	99,896	FI
Finnfund	0,657%	10/09/2013	10/09/2018	EUR	66.300.000	66.300.000	58,61	0,634%	-	Financial Services	100,000	FI
Fonciere Atland	5,500%	08/03/2013	08/03/2018	EUR	6.494.850	6.494.850	-	3,444%	-	Real Estate	100,000	FR
Frankfurter Sparkasse	1,300%	08/07/2013	08/07/2018	EUR	12.867.500	12.867.500	-	0,767%	-	Banks	100,000	DE
Free and Hanseatic City of Hamburg	0,875%	27/03/2013	27/03/2018	EUR	127.720.000	127.720.000	-	0,186%	-	Government Local	99,796	DE
Free and Hanseatic City of Hamburg	1,100%	21/02/2013	21/02/2018	EUR	39.600.000	39.600.000	-	0,177%	-	Government Local	99,950	DE
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital SA	2,933%	26/04/2013	26/04/2018	EUR	976.455.000	976.455.000	-	4,867%	BB+	Exploration & Production	100,000	LU
Gazprom OAO Via Gaz Capital SA	3,700%	25/07/2013	25/07/2018	EUR	1.190.592.000	1.190.592.000	-	4,269%	BB+	Exploration & Production	100,000	LU
Gazprombank OJSC Via GPB Eurobond Finance PLC	3,984%	30/10/2013	30/10/2018	EUR	1.377.010.000	1.377.010.000	-	5,418%	BB+	Banks	100,000	IE
Gebr Sanders GmbH & Co KG	8,750%	22/10/2013	22/10/2018	EUR	24.817.320	24.817.320	-	12,151%	-	Apparel & Textile Products	100,000	DE
GELF Bond Issuer I SA	3,125%	03/04/2013	03/04/2018	EUR	642.260.000	642.260.000	-	1,057%	BBB	Real Estate	99,872	LU
German Pellets GmbH	7,250%	09/07/2013	09/07/2018	EUR	92.100.240	92.100.240	-	6,038%	-	Home Improvement	100,000	DE
GRENKE FINANCE Plc	2,250%	09/12/2013	10/12/2018	EUR	171.538.750	171.538.750	-	1,064%	BBB+	Commercial Finance	100,000	IE
Hamburger Sparkasse AG	1,250%	30/10/2013	30/10/2018	EUR	6.885.050	6.885.050	-	0,390%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,350%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	65.347.000	65.347.000	-	0,299%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,250%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	65.347.000	65.347.000	-	0,299%	-	Banks	99,950	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,000%	19/11/2013	19/11/2018	EUR	6.456.624	67.679.500	-	0,753%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,600%	03/09/2013	03/09/2018	EUR	21.209.583	65.856.000	-	0,718%	-	Banks	99,400	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,250%	03/09/2013	03/09/2018	EUR	6.781.851	65.856.000	-	0,754%	-	Banks	99,700	DE
Hamburger Sparkasse AG	0,736%	21/06/2013	21/06/2018	EUR	2.825.466	13.141.700	64,78	0,626%	-	Banks	100,000	DE

Heineken NV	1,250%	18/04/2013	18/04/2018	EUR	130.798.000	130.798.000	-	0,587%	BBB+	Food & Beverage	99,429	NL
HSBC France SA	1,625%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	1.360.020.000	1.360.020.000	-	0,497%	AA-	Banks	99,871	FR
HSH Nordbank AG	1,375%	02/10/2013	02/10/2018	EUR	679.150.000	679.150.000	-	0,048%	-	Banks	99,617	DE
HSH Nordbank AG	2,000%	17/10/2013	17/10/2018	EUR	519.171.200	519.171.200	-	0,841%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,700%	18/10/2013	18/10/2018	EUR	684.575.000	684.575.000	59,13	0,569%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,500%	26/02/2013	26/02/2018	EUR	26.105.000	26.105.000	53,90	0,587%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,600%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	65.347.000	65.347.000	-	0,736%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,400%	03/07/2013	03/07/2018	EUR	13.013.100	13.013.100	-	0,860%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,500%	08/08/2013	08/08/2018	EUR	13.391.200	13.391.200	66,02	0,708%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,250%	11/07/2013	11/07/2018	EUR	9.115.400	9.115.400	64,63	0,694%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,089%	24/07/2013	24/07/2018	EUR	6.602.900	6.602.900	59,52	0,643%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,000%	23/01/2013	23/01/2018	EUR	1.330.740	1.330.740	65,76	0,706%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,600%	11/07/2013	11/07/2018	EUR	88.549.600	88.549.600	-	0,760%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,050%	27/11/2013	27/11/2018	EUR	10.856.240	10.856.240	-	0,876%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,750%	19/09/2013	19/09/2018	EUR	47.302.850	47.302.850	-	0,812%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,500%	23/10/2013	23/10/2018	EUR	5.515.480	5.515.480	67,61	0,724%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,500%	09/08/2013	09/08/2018	EUR	2.668.680	2.668.680	-	0,916%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,250%	23/01/2013	23/01/2018	EUR	6.653.700	6.653.700	-	0,801%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,600%	25/06/2013	25/06/2018	EUR	2.619.800	2.619.800	-	0,904%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,935%	04/06/2013	04/06/2018	EUR	52.282.000	52.282.000	60,52	0,653%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,250%	23/05/2013	23/05/2018	EUR	12.933.000	12.933.000	61,30	0,661%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,500%	18/04/2013	18/04/2018	EUR	2.223.566	2.223.566	-	0,872%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,390%	08/02/2013	08/02/2018	EUR	6.677.450	6.677.450	-	0,814%	-	Banks	100,000	DE
HTM Sport GmbH	5,250%	26/09/2013	26/09/2018	EUR	80.836.800	80.836.800	-	4,334%	-	Leisure Products Manufacturing	101,000	AT

HYPO NOE Gruppe Bank AG	1,625%	23/04/2013	23/04/2018	EUR	650.525.000	650.525.000	-	1,350%	A	Consumer Finance	99,520	AT
HYPO NOE Gruppe Bank AG	0,890%	30/04/2013	30/04/2018	EUR	2.631.640	2.631.640	-	0,558%	-	Consumer Finance	100,000	AT
HYPO NOE Landesbank AG	1,250%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	6.835.700	6.835.700	182,27	1,871%	-	Consumer Finance	101,000	AT
Hypo-Bank Burgenland AG	2,000%	08/07/2013	08/07/2018	EUR	6.433.750	6.433.750	-	1,173%	-	Consumer Finance	100,000	AT
Iccrea Banca SpA	3,600%	20/03/2013	20/03/2018	EUR	647.090.000	647.090.000	-	1,282%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	3,250%	05/06/2013	05/06/2018	EUR	130.888.000	130.888.000	-	1,783%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	3,600%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	68.357.000	68.357.000	-	0,836%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	3,500%	01/03/2013	01/03/2018	EUR	65.211.500	65.211.500	-	1,837%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	3,500%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	66.068.000	66.068.000	-	1,892%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	3,900%	04/02/2013	04/02/2018	EUR	24.363.360	24.363.360	-	1,853%	-	Banks	100,000	IT
IKB Deutsche Industriebank AG	3,000%	09/08/2013	09/08/2018	EUR	6.671.700	6.671.700	-	0,847%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	3,200%	23/10/2013	23/10/2018	EUR	6.894.350	6.894.350	-	0,842%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	3,200%	02/12/2013	02/12/2018	EUR	6.775.250	6.775.250	-	0,977%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	2,900%	26/06/2013	26/06/2018	EUR	6.503.600	6.503.600	-	0,831%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	3,000%	19/09/2013	19/09/2018	EUR	6.757.550	6.757.550	-	0,842%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Immigon Portfolioabbau AG	8,981%	26/07/2013	26/07/2018	EUR	93.670.563	93.670.563	2.968,21	29,660%	-	Banks	100,000	AT
Immigon Portfolioabbau AG	1,800%	24/05/2013	24/05/2018	EUR	1.291.920	1.291.920	1.414,82	14,126%	-	Banks	101,500	AT
ING Bank NV	1,875%	27/02/2013	27/02/2018	EUR	2.292.307.500	2.292.307.500	-	0,414%	A	Banks	99,608	NL
ING Bank NV	0,900%	31/10/2013	31/10/2018	EUR	4.796.403	4.796.403	65,44	0,632%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,400%	25/10/2013	25/10/2018	EUR	6.897.400	6.897.400	66,99	0,648%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,100%	18/10/2013	18/10/2018	EUR	5.476.600	5.476.600	66,32	0,641%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,000%	11/10/2013	11/10/2018	EUR	13.539.000	13.539.000	63,00	0,608%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,300%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	5.128.640	5.128.640	65,61	0,634%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	0,910%	21/11/2013	21/11/2018	EUR	13.458.900	13.458.900	61,78	0,596%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	0,810%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	703.815	703.815	64,43	0,622%	-	Banks	100,000	NL

ING Bank NV	1,400%	25/11/2013	25/11/2018	EUR	6.756.950	6.756.950	66,23	0,640%	-	Banks	100,500	NL
ING Bank NV	1,050%	20/09/2013	20/09/2018	EUR	13.526.500	13.526.500	63,75	0,615%	-	Banks	100,000	NL
ING Belgium SA/NV	1,125%	10/12/2013	10/12/2018	EUR	1.376.950.000	1.376.950.000	-	0,153%	-	Banks	99,831	BE
ING-DiBa AG	0,965%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	27.147.400	27.147.400	-	0,149%	-	Banks	99,927	DE
Intesa Sanpaolo SpA	2,760%	15/05/2013	15/05/2018	EUR	755.238.735	755.238.735	137,15	1,350%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,250%	24/09/2013	24/09/2018	EUR	1.011.997.500	1.011.997.500	-	0,145%	-	Banks	99,734	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,200%	15/11/2013	15/11/2018	EUR	205.775.510	205.775.510	129,26	1,271%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,911%	18/04/2013	18/04/2018	EUR	196.197.000	196.197.000	105,09	1,029%	BBB-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,000%	11/12/2013	11/12/2018	EUR	55.389.433	55.389.433	-	1,677%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,240%	10/04/2013	10/04/2018	EUR	47.648.717	47.648.717	132,11	1,299%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,000%	08/02/2013	08/02/2018	EUR	35.865.919	35.865.919	118,40	1,162%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,530%	21/01/2013	21/01/2018	EUR	78.516.442	78.516.442	162,81	1,606%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,530%	18/01/2013	18/01/2018	EUR	24.873.743	24.873.743	160,04	1,578%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,980%	10/07/2013	10/07/2018	EUR	56.082.637	56.082.637	169,39	1,672%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,080%	16/10/2013	16/10/2018	EUR	69.425.321	69.425.321	158,49	1,563%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,240%	07/08/2013	07/08/2018	EUR	99.531.264	99.531.264	169,12	1,669%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,800%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	50.081.289	50.081.289	161,31	1,591%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,136%	18/09/2013	18/09/2018	EUR	85.598.705	85.598.705	160,97	1,588%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,842%	07/05/2013	07/05/2018	EUR	196.257.000	196.257.000	136,09	1,339%	BBB-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,911%	26/04/2013	26/04/2018	EUR	195.291.000	195.291.000	124,95	1,227%	BBB-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	3,300%	16/01/2013	16/01/2018	EUR	265.674.000	265.674.000	-	0,907%	BBB-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	2,893%	06/05/2013	06/05/2018	EUR	196.128.000	196.128.000	122,77	1,206%	BBB-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo Vita SpA	5,350%	18/09/2013	18/09/2018	EUR	667.905.000	667.905.000	-	1,528%	-	Life Insurance	100,000	IT
IPM GmbH & Co.KG	5,000%	31/10/2013	31/10/2018	EUR	20.398.650	20.398.650	-	5,553%	-	Real Estate	100,000	DE

Italcementi Finance SA	6,125%	21/02/2013	21/02/2018	EUR	660.000.000	660.000.000	-	1,714%	BB	Construction Materials Manufacturing	99,477	FR
JCDecaux SA	2,000%	08/02/2013	08/02/2018	EUR	667.745.000	667.745.000	-	0,554%	BBB	Publishing & Broadcasting	99,497	FR
K+S AG	3,125%	06/12/2013	06/12/2018	EUR	684.810.000	684.810.000	-	0,717%	BBB	Chemicals	99,777	DE
KBC IFIMA SA	2,125%	10/09/2013	10/09/2018	EUR	994.500.000	994.500.000	-	0,480%	A	Banks	99,728	LU
KBC IFIMA SA	2,000%	04/12/2013	04/12/2018	EUR	27.188.800	27.188.800	-	0,701%	-	Banks	100,000	LU
KBC IFIMA SA	2,200%	30/10/2013	30/10/2018	EUR	119.569.909	119.569.909	-	0,660%	-	Banks	100,000	LU
KBC IFIMA SA	2,000%	27/12/2013	27/12/2018	EUR	17.765.237	17.765.237	-	0,710%	-	Banks	100,000	LU
Kering	1,875%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	678.700.000	678.700.000	-	0,484%	BBB	Apparel & Textile Products	99,703	FR
Kieler Volksbank eG	1,000%	14/03/2013	14/03/2018	EUR	26.016.800	26.016.800	-	0,611%	-	Banks	100,000	DE
Kommalkredit Austria AG	1,625%	25/09/2013	25/09/2018	EUR	676.415.000	676.415.000	-	0,513%	-	Banks	99,772	AT
Kreissparkasse Koeln	1,000%	26/11/2013	26/11/2018	EUR	338.917.500	338.917.500	-	0,215%	-	Banks	99,670	DE
Kreissparkasse Koeln	1,250%	08/02/2013	08/02/2018	EUR	13.354.900	13.354.900	-	0,331%	-	Banks	100,235	DE
Kreissparkasse Wesermuende-Hadeln	1,500%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	6.606.800	6.606.800	-	0,801%	-	Banks	97,100	DE
Land Thueringen	0,750%	26/04/2013	26/04/2018	EUR	390.582.000	390.582.000	-	0,066%	-	Government Regional	99,824	DE
Landesbank Berlin AG	3,200%	01/10/2013	11/10/2018	EUR	5.410.000	5.410.000	-	0,951%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	3,250%	01/10/2013	11/10/2018	EUR	2.705.000	2.705.000	-	1,078%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,000%	09/04/2013	09/04/2018	EUR	13.082.400	13.082.400	51,86	0,567%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,100%	10/09/2013	10/09/2018	EUR	3.978.000	3.978.000	-	0,648%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,150%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	2.714.800	2.714.800	-	0,655%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Berlin AG	1,050%	05/11/2013	05/11/2018	EUR	2.693.840	2.693.840	-	0,643%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	1,000%	26/06/2013	26/06/2018	EUR	1.300.720.000	1.300.720.000	-	0,009%	-	Banks	99,971	DE
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	1,300%	23/10/2013	23/10/2018	EUR	137.887.000	137.887.000	-	0,526%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	1,150%	14/08/2013	14/08/2018	EUR	132.559.000	132.559.000	-	0,505%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	1,000%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	130.694.000	130.694.000	-	0,463%	-	Banks	100,000	DE

Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,300%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	134.385.000	134.385.000	-	0,533%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,350%	04/10/2013	04/10/2018	EUR	135.524.000	135.524.000	-	0,522%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,300%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	132.136.000	132.136.000	-	0,506%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,200%	13/11/2013	13/11/2018	EUR	134.544.000	134.544.000	-	0,529%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,200%	17/10/2013	17/10/2018	EUR	136.624.000	136.624.000	46,67	0,445%	-	Banks	100,850	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,000%	13/11/2013	13/11/2018	EUR	134.544.000	134.544.000	51,63	0,494%	-	Banks	100,850	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,250%	11/09/2013	11/09/2018	EUR	133.013.000	133.013.000	-	0,515%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,800%	02/10/2013	02/10/2018	EUR	135.830.000	135.830.000	-	0,509%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,100%	10/01/2013	10/01/2018	EUR	132.601.000	132.601.000	-	0,414%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,900%	11/09/2013	11/09/2018	EUR	133.013.000	133.013.000	-	0,506%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,125%	02/10/2013	02/10/2018	EUR	135.830.000	135.830.000	-	0,165%	-	Banks	99,490	DE
Landesbank Saar	1,375%	25/10/2013	25/10/2018	EUR	68.974.000	68.974.000	-	0,597%	-	Banks	99,600	DE
Landesbank Saar	1,200%	13/08/2013	13/08/2018	EUR	13.252.800	13.252.800	-	0,336%	-	Banks	99,980	DE
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	1,000%	19/11/2013	19/11/2018	EUR	1.353.590.000	1.353.590.000	-	0,022%	AAA	Government Development Banks	99,758	DE
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	1,100%	03/07/2013	03/07/2018	EUR	32.532.750	32.532.750	-	0,366%	AAA	Government Development Banks	100,000	DE
Lansforsakringar Bank AB	0,831%	20/03/2013	20/03/2018	EUR	27.177.780	27.177.780	43,93	0,417%	-	Banks	100,000	SE
LBBW	0,362%	11/01/2013	11/01/2018	EUR	133.598.000	133.598.000	19,92	0,177%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,400%	15/02/2013	15/02/2018	EUR	133.537.000	133.537.000	-	0,388%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,160%	19/06/2013	19/06/2018	EUR	134.020.000	134.020.000	-	0,497%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,387%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	136.714.000	136.714.000	20,50	0,183%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,300%	10/10/2013	10/10/2018	EUR	135.223.000	135.223.000	-	0,541%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,450%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	136.714.000	136.714.000	-	0,384%	-	Banks	100,080	DE
LBBW	1,500%	10/09/2013	10/09/2018	EUR	112.710.000	112.710.000	-	0,144%	-	Banks	100,320	DE
LBBW	1,140%	29/10/2013	29/10/2018	EUR	20.617.650	20.617.650	-	0,186%	-	Banks	99,990	DE

LBBW	1,000%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	6.719.250	6.719.250	-	0,210%	-	Banks	99,850	DE
LBBW	1,250%	15/08/2013	15/08/2018	EUR	46.412.100	46.412.100	-	0,177%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,150%	22/11/2013	22/11/2018	EUR	135.385.000	135.385.000	-	0,553%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,250%	15/01/2013	15/01/2018	EUR	133.350.000	133.350.000	-	0,372%	-	Banks	100,330	DE
LFA Foerderbank Bayern	0,850%	31/05/2013	11/06/2018	EUR	279.857.955	279.857.955	-	0,084%	-	Government Development Banks	99,800	DE
LFA Foerderbank Bayern	0,000%	12/09/2013	12/09/2018	EUR	39.931.800	39.931.800	0,73	0,055%	-	Government Development Banks	100,000	DE
LFA Foerderbank Bayern	0,810%	11/04/2013	11/04/2018	EUR	131.237.000	131.237.000	-	0,058%	-	Government Development Banks	99,970	DE
Linea Group Holding SpA	3,875%	28/11/2013	28/11/2018	EUR	407.877.000	407.877.000	-	1,618%	-	Utilities	99,444	IT
Lloyds Bank PLC	1,875%	10/10/2013	10/10/2018	EUR	1.352.230.000	1.352.230.000	-	0,519%	A	Banks	99,929	GB
Lloyds Bank PLC	0,531%	15/01/2013	15/01/2018	EUR	200.025.000	200.025.000	74,65	0,725%	A	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	0,525%	04/04/2013	04/04/2018	EUR	12.232.770	12.232.770	56,27	0,541%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	0,582%	09/01/2013	09/01/2018	EUR	65.345.000	65.345.000	47,36	0,452%	A	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	0,532%	12/07/2013	12/07/2018	EUR	196.135.500	196.135.500	74,29	0,721%	-	Banks	100,000	GB
Louis Dreyfus Commodities BV	3,875%	30/07/2013	30/07/2018	EUR	530.168.000	530.168.000	-	2,947%	-	Retail - Consumer Staples	99,444	NL
Madrikena Red de Gas Finance BV	3,779%	11/09/2013	11/09/2018	EUR	665.065.000	665.065.000	-	0,776%	BBB /*+	Utilities	100,000	ES
Mantovabanca 1896 Credito Cooperativo SC	3,000%	01/07/2013	01/07/2018	EUR	482.987	6.526.850	-	2,489%	-	Banks	100,000	IT
Mantovabanca 1896 Credito Cooperativo SC	3,000%	07/10/2013	07/10/2018	EUR	135.748	13.574.800	-	2,528%	-	Banks	100,000	IT
Mediobanca SpA	2,300%	30/09/2013	30/09/2018	EUR	1.698.286.400	1.698.286.400	-	1,406%	BBB-	Banks	100,000	IT
Mediobanca SpA	0,208%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	660.039.611	660.039.611	112,93	1,107%	BBB-	Banks	100,000	IT
Mediobanca SpA	1,619%	25/02/2013	25/02/2018	EUR	47.702.399	47.702.399	133,06	1,379%	BBB-	Banks	100,000	IT
Mediobanca SpA	1,287%	28/02/2013	28/02/2018	EUR	8.845.552	8.845.552	136,45	1,342%	BBB-	Banks	100,000	IT
Mediobanca SpA	3,200%	04/12/2013	04/12/2018	EUR	40.632.302	40.632.302	-	1,502%	-	Banks	100,000	IT
Muenchener Hypothekenbank eG	1,125%	04/10/2013	04/10/2018	EUR	1.016.430.000	1.016.430.000	-	0,019%	-	Consumer Finance	99,629	DE

Muenchener Hypothekenbank eG	0,472%	11/01/2013	11/01/2018	EUR	40.079.400	40.079.400	19,59	0,174%	-	Consumer Finance	99,930	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,179%	17/07/2013	17/07/2018	EUR	13.139.300	13.139.300	16,89	0,217%	-	Consumer Finance	99,920	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,098%	26/11/2013	26/11/2018	EUR	13.556.700	13.556.700	24,14	0,219%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,567%	01/03/2013	01/03/2018	EUR	13.042.300	13.042.300	25,32	0,231%	-	Consumer Finance	100,990	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,416%	26/06/2013	26/06/2018	EUR	13.007.200	13.007.200	26,40	0,242%	-	Consumer Finance	100,990	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,472%	07/02/2013	07/02/2018	EUR	13.400.800	13.400.800	15,88	0,207%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	1,330%	12/07/2013	12/07/2018	EUR	6.537.850	6.537.850	-	0,394%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	1,000%	28/11/2013	28/11/2018	EUR	13.595.900	13.595.900	-	0,189%	-	Consumer Finance	99,930	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	1,375%	29/01/2013	29/01/2018	EUR	67.402.000	67.402.000	-	0,241%	-	Consumer Finance	99,865	DE
Municipality Finance PLC	0,082%	10/01/2013	10/01/2018	EUR	331.502.500	331.502.500	5,47	0,033%	AA+	Government Agencies	100,000	FI
Natixis Pfandbriefbank AG	1,230%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	10.942.480	10.942.480	-	0,317%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Nederlandse Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	1,250%	13/11/2013	13/11/2018	EUR	672.720.000	672.720.000	-	0,077%	AA+	Government Development Banks	99,966	NL
NIBC Bank NV	1,750%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	678.700.000	678.700.000	-	0,145%	AAA	Financial Services	99,952	NL
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,125%	04/06/2013	04/06/2018	EUR	130.705.000	130.705.000	-	0,603%	-	Banks	98,910	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,437%	28/05/2013	28/05/2018	EUR	257.308.000	257.308.000	46,52	0,443%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,125%	08/03/2013	08/03/2018	EUR	259.794.000	259.794.000	-	0,531%	-	Banks	99,550	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,750%	11/06/2013	11/06/2018	EUR	66.389.500	66.389.500	-	0,624%	-	Banks	100,000	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,250%	27/03/2013	27/03/2018	EUR	255.440.000	255.440.000	-	0,538%	-	Banks	100,160	DE
Nordea Bank AB	1,375%	12/04/2013	12/04/2018	EUR	1.964.190.000	1.964.190.000	-	0,376%	AA-	Diversified Banks	99,938	SE
Nordea Bank AB	0,488%	22/05/2013	22/05/2018	EUR	270.207.000	270.207.000	24,84	0,226%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank AB	0,565%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	19.873.480	19.873.480	43,92	0,417%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank AB	0,558%	22/05/2013	22/05/2018	EUR	25.734.000	25.734.000	43,45	0,412%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank Finland Abp	1,375%	28/08/2013	28/08/2018	EUR	1.999.980.000	1.999.980.000	-	0,084%	-	Banks	99,952	FI
Nordea Bank Finland Abp	5,086%	20/03/2013	20/04/2018	EUR	6.470.900	6.470.900	126,79	1,246%	-	Banks	100,000	FI

Novo Banco SA	4,750%	15/01/2013	15/01/2018	EUR	666.750.000	666.750.000	-	3,238%	NR	Banks	99,349	PT
NRW Bank	1,250%	22/10/2013	22/10/2018	EUR	1.378.740.000	1.378.740.000	-	0,036%	AA-	Government Development Banks	99,731	DE
NRW Bank	2,250%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	195.078.000	195.078.000	-	0,229%	AA-	Government Development Banks	104,190	DE
Nykredit Bank A/S	0,865%	27/03/2013	27/03/2018	EUR	63.860.000	63.860.000	50,69	0,485%	A	Banks	100,000	DK
Nykredit Realkredit A/S	1,750%	02/05/2013	02/05/2018	EUR	653.470.000	653.470.000	-	0,434%	A+ /*-	Consumer Finance	99,780	DK
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH	1,875%	22/11/2013	22/11/2018	EUR	812.310.000	812.310.000	-	0,700%	-	Wireline Telecommunications Services	99,162	DE
Oberbank AG	0,765%	27/12/2013	27/12/2018	EUR	6.884.150	6.884.150	78,14	0,759%	-	Banks	100,000	AT
Orange SA	1,875%	03/09/2013	03/09/2018	EUR	1.119.552.000	1.119.552.000	-	0,514%	BBB+	Wireline Telecommunications Services	99,670	FR
Orange SA	0,556%	26/09/2013	26/09/2018	EUR	67.364.000	67.364.000	128,43	1,262%	-	Wireline Telecommunications Services	100,000	FR
OTE PLC	7,875%	07/02/2013	07/02/2018	EUR	938.056.000	938.056.000	-	7,307%	B /*-	Wireline Telecommunications Services	99,493	GB
paragon AG	7,250%	02/07/2013	02/07/2018	EUR	16.925.220	16.925.220	-	3,165%	-	Hardware	100,000	DE
Peine GmbH	8,000%	05/07/2013	05/07/2018	EUR	19.248.750	19.248.750	-	7,524%	-	Retail - Consumer Discretionary	100,000	DE
Peugeot SA	7,375%	06/03/2013	06/03/2018	EUR	1.052.334.117	1.299.040.000	-	1,491%	BB-	Automobiles Manufacturing	99,494	FR
PNE Wind AG	8,000%	14/05/2013	01/06/2018	EUR	129.536.000	129.536.000	-	5,620%	-	Renewable Energy	100,000	DE
Pohjola Bank Oyj	1,750%	29/08/2013	29/08/2018	EUR	992.970.000	992.970.000	-	0,426%	AA-	Banks	99,834	FI
Pohjola Bank Oyj	1,250%	14/05/2013	14/05/2018	EUR	647.680.000	647.680.000	-	0,380%	AA-	Banks	99,731	FI
Pohjola Bank Oyj	0,376%	20/09/2013	20/09/2018	EUR	13.526.500	13.526.500	38,00	0,358%	-	Banks	100,000	FI
Porr Ag	6,250%	26/11/2013	26/11/2018	EUR	67.783.500	67.783.500	-	2,323%	-	Industrial Other	100,000	AT
Poste Italiane SpA	3,250%	18/06/2013	18/06/2018	EUR	1.004.632.500	1.004.632.500	-	0,705%	BBB-	Life Insurance	99,660	IT
Prada SpA	2,750%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	171.776.800	171.776.800	-	1,188%	-	Apparel & Textile Products	99,641	IT

Prosegur Cia de Seguridad SA	2,750%	02/04/2013	02/04/2018	EUR	641.305.000	641.305.000	-	0,823%	BBB	Consumer Services	99,627	ES
Raiffeisen Bank International AG	1,875%	08/11/2013	08/11/2018	EUR	668.345.000	668.345.000	-	1,480%	BBB	Banks	99,750	AT
Raiffeisen Bank International AG	1,920%	29/01/2013	29/01/2018	EUR	7.414.220	7.414.220	-	1,492%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	0,886%	26/09/2013	26/09/2018	EUR	66.016.720	66.016.720	111,60	1,094%	BBB	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	0,385%	27/12/2013	27/12/2018	EUR	123.914.700	908.707.800	13,45	0,113%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	1,750%	23/01/2013	23/01/2018	EUR	62.544.780	66.537.000	-	1,382%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	1,500%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	8.063.100	8.063.100	-	1,576%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	3,350%	30/12/2013	30/12/2018	EUR	37.950.825	37.950.825	119,42	1,172%	-	Banks	115,407	AT
Raiffeisen Bank International AG	1,130%	29/01/2013	29/01/2018	EUR	20.220.600	20.220.600	113,11	1,109%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,700%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	63.725.480	63.725.480	-	1,207%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,500%	25/04/2013	25/04/2018	EUR	63.736.260	63.736.260	-	1,173%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	0,792%	08/02/2013	08/02/2018	EUR	65.439.010	65.439.010	131,16	1,290%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,750%	30/08/2013	30/08/2018	EUR	64.700.580	64.700.580	-	1,232%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,250%	22/01/2013	22/01/2018	EUR	65.198.910	65.198.910	134,63	1,324%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,750%	22/01/2013	22/01/2018	EUR	65.198.910	65.198.910	-	1,137%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Kaernten GmbH	1,875%	08/01/2013	08/01/2018	EUR	64.042.020	64.042.020	-	1,150%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,750%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	46.685.097	46.685.097	-	2,103%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,500%	14/06/2013	14/06/2018	EUR	14.477.508	14.477.508	-	2,190%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	2,000%	18/10/2013	18/10/2018	EUR	28.704.230	28.704.230	-	2,169%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	0,750%	07/03/2013	07/03/2018	EUR	3.929.220	3.929.220	70,63	0,754%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	0,791%	13/02/2013	13/02/2018	EUR	13.452.600	13.452.600	207,85	2,057%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	1,550%	12/02/2013	12/02/2018	EUR	87.912.084	53.851.200	150,38	1,482%	-	Banks	99,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	0,761%	15/02/2013	15/02/2018	EUR	13.353.700	13.353.700	152,63	1,504%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	0,226%	18/09/2013	18/09/2018	EUR	26.716.200	26.716.200	19,33	0,171%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	0,271%	13/11/2013	13/11/2018	EUR	26.908.800	26.908.800	28,09	0,259%	-	Banks	100,000	AT

Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	1,840%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	6.108.165	6.108.165	-	1,359%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	1,600%	27/05/2013	28/05/2018	EUR	52.106.288	51.718.400	157,97	1,558%	-	Banks	101,200	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	1,365%	29/05/2013	29/05/2018	EUR	12.935.900	12.935.900	-	1,368%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	1,550%	14/05/2013	14/05/2018	EUR	5.570.048	6.476.800	165,35	1,632%	-	Banks	101,450	AT
Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG	0,186%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	34.195.250	34.195.250	16,49	0,143%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen-Landesbank Tirol AG	1,500%	25/06/2013	25/06/2018	EUR	26.198.000	26.198.000	-	1,229%	-	Banks	100,300	AT
Raiffeisen-Landesbank Tirol AG	1,750%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	27.168.000	27.168.000	-	1,172%	-	Banks	100,850	AT
Raiffeisen-Landesbank Tirol AG	0,187%	11/12/2013	11/12/2018	EUR	3.450.625	3.450.625	20,16	0,180%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen-Landesbank Tirol AG	1,750%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	27.148.000	27.148.000	-	1,264%	-	Banks	100,800	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	0,705%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	25.643.200	25.643.200	134,26	1,321%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	1,600%	29/01/2013	29/01/2018	EUR	1.348.040	1.348.040	-	1,599%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	0,921%	15/02/2013	15/02/2018	EUR	13.353.700	13.353.700	136,70	1,345%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	0,186%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	34.195.250	34.195.250	16,40	0,142%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	1,100%	27/03/2013	27/03/2018	EUR	12.772.000	12.772.000	-	0,310%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	0,187%	11/12/2013	11/12/2018	EUR	3.450.625	3.450.625	20,16	0,180%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenverband Salzburg	0,881%	23/04/2013	23/04/2018	EUR	39.031.500	39.031.500	137,22	1,350%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,500%	12/09/2013	12/09/2018	EUR	39.931.800	39.931.800	-	1,259%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,625%	21/10/2013	21/10/2018	EUR	41.028.000	41.028.000	-	1,273%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,750%	28/06/2013	28/06/2018	EUR	39.015.600	39.015.600	-	1,241%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,500%	02/04/2013	02/04/2018	EUR	38.478.300	38.478.300	-	1,195%	-	Banks	100,250	AT
Region Wallonne Belgium	0,405%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	12.821.600	12.821.600	40,05	0,378%	-	Government Regional	100,000	BE
REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	4,125%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	407.535.000	407.535.000	-	0,969%	BB+	Utilities	99,668	PT
Renault SA	3,625%	19/09/2013	19/09/2018	EUR	1.216.359.000	1.216.359.000	-	0,959%	BBB-	Automobiles Manufacturing	99,587	FR

Rickmers Holding GmbH & Cie KG	8,875%	11/06/2013	11/06/2018	EUR	365.142.250	365.142.250	-	8,208%	-	Transportation & Logistics	100,000	DE
Romagna Est Banca di Credito Cooperativo Societa Cooperativa	2,700%	22/07/2013	22/07/2018	EUR	689.952	689.952	329,80	3,346%	-	Banks	100,000	IT
Romagna Est Banca di Credito Cooperativo Societa Cooperativa	3,000%	20/05/2013	20/05/2018	EUR	477.637	477.637	-	3,257%	-	Banks	100,000	IT
Romagna Est Banca di Credito Cooperativo Societa Cooperativa	2,250%	10/10/2013	10/10/2018	EUR	45.976	45.976	324,59	3,294%	-	Banks	100,000	IT
Royal Bank of Scotland PLC/The	1,250%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	13.584.500	13.584.500	114,84	1,126%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	0,481%	28/01/2013	29/01/2018	EUR	20.187.300	20.187.300	84,51	0,823%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	0,431%	19/04/2013	19/04/2018	EUR	6.533.800	6.533.800	101,70	0,995%	-	Banks	100,000	GB
Royal Bank of Scotland PLC/The	0,328%	22/02/2013	22/02/2018	EUR	6.595.200	6.595.200	112,00	1,098%	-	Banks	100,000	GB
Rudolf Woehrl AG	6,500%	12/02/2013	12/02/2018	EUR	40.388.400	40.388.400	-	2,728%	-	Retail - Consumer Discretionary	100,000	DE
SA de Obras y Servicios COPASA	7,500%	19/12/2013	19/12/2018	EUR	68.326.000	68.326.000	-	7,804%	-	Industrial Other	100,000	ES
Salini Impregilo SpA	6,125%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	528.544.000	528.544.000	-	2,510%	BB+	Industrial Other	99,477	IT
Sanha GmbH & Co KG	7,750%	04/06/2013	04/06/2018	EUR	49.014.375	49.014.375	-	8,426%	-	Metals & Mining	100,000	DE
SATO Oyj	2,875%	20/03/2013	20/03/2018	EUR	129.418.000	129.418.000	-	1,339%	-	Real Estate	99,633	FI
SBAB Bank AB	1,375%	22/04/2013	02/05/2018	EUR	978.577.500	978.577.500	-	0,418%	A	Consumer Finance	99,923	SE
SecurAsset SA	3,400%	28/06/2013	04/07/2018	EUR	65.026.000	65.026.000	165,80	1,636%	-	Financial Services	100,000	LU
SG Issuer SA	5,750%	30/12/2013	10/01/2019	EUR	13.800.300	13.800.300	-	2,599%	-	Financial Services	100,000	LU
SG Issuer SA	6,500%	06/08/2013	10/07/2018	EUR	3.989.580	3.989.580	-	2,159%	-	Financial Services	100,000	LU
Societe Generale Effekten GmbH	4,000%	31/01/2013	10/01/2018	EUR	67.922.500	67.922.500	-	2,113%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale Effekten GmbH	2,750%	09/08/2013	23/08/2018	EUR	66.717.000	66.717.000	215,03	2,128%	-	Banks	100,000	DE
Societe Generale SA	0,597%	07/06/2013	07/06/2018	EUR	211.545.600	211.545.600	75,48	0,733%	A	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Generale SA	0,876%	24/09/2013	24/09/2018	EUR	13.493.300	13.493.300	61,97	0,598%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Generale SA	1,750%	24/09/2013	24/09/2018	EUR	1.349.330	1.349.330	-	0,771%	-	Diversified Banks	100,000	FR
Societe Publique de Gestion de l'Eau SA	1,700%	06/05/2013	06/05/2018	EUR	3.922.560	3.922.560	-	0,761%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	BE

Societe Publique de Gestion de l'Eau SA	2,052%	21/10/2013	21/10/2018	EUR	15.453.880	15.453.880	-	0,708%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	BE
Societe Publique de Gestion de l'Eau SA	2,025%	09/10/2013	09/10/2018	EUR	13.511.400	13.511.400	-	0,716%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	BE
Societe Wallonne du Credit Social SA	1,890%	04/04/2013	04/04/2018	EUR	6.438.300	6.438.300	-	0,347%	-	Consumer Finance	100,000	BE
Sonae Investimentos SGPS SA	3,549%	12/06/2013	12/06/2018	EUR	66.697.500	66.697.500	313,99	3,188%	-	Supermarkets & Pharmacies	100,000	PT
SpareBank 1 Boligkredditt AS	0,107%	04/06/2013	04/06/2018	EUR	91.493.500	91.493.500	16,25	0,141%	-	Banks	100,000	NO
SpareBank 1 Nord Norge	0,971%	16/01/2013	16/01/2018	EUR	19.925.550	19.925.550	63,15	0,610%	-	Banks	100,000	NO
SpareBank 1 SMN	2,125%	21/02/2013	21/02/2018	EUR	660.000.000	660.000.000	-	0,491%	-	Banks	99,916	NO
Sparebanken Vest	1,087%	11/01/2013	11/01/2018	EUR	13.359.800	13.359.800	46,85	0,446%	-	Banks	99,755	NO
Sparebanken Vest Boligkredditt AS	1,500%	11/09/2013	11/09/2018	EUR	665.065.000	665.065.000	-	0,140%	-	Consumer Finance	99,823	NO
Sparebanken Vest Boligkredditt AS	0,136%	13/09/2013	13/09/2018	EUR	93.019.500	93.019.500	11,51	0,093%	-	Consumer Finance	100,000	NO
Sparkasse Aachen	1,125%	31/07/2013	31/07/2018	EUR	39.828.300	39.828.300	-	0,209%	-	Banks	99,540	DE
Sparkasse Aachen	1,200%	04/10/2013	04/10/2018	EUR	27.104.800	27.104.800	-	0,235%	-	Banks	99,790	DE
Sparkasse Hannover	1,000%	19/11/2013	19/11/2018	EUR	203.038.500	203.038.500	-	0,178%	-	Banks	99,444	DE
Sparkasse KoelnBonn	1,400%	30/09/2013	01/10/2018	EUR	27.062.600	27.062.600	-	0,581%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse KoelnBonn	1,000%	27/05/2013	28/05/2018	EUR	25.859.200	25.859.200	-	0,565%	-	Banks	100,050	DE
Sparkasse Krefeld	1,500%	27/08/2013	27/08/2018	EUR	33.469.500	33.469.500	-	0,671%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Kufstein - Tiroler Sparkasse von 1877	1,500%	07/10/2013	07/10/2018	EUR	6.787.400	6.787.400	-	1,544%	-	Banks	100,000	AT
Sparkasse Rosenheim-Bad Aibling	1,000%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	6.800.100	6.800.100	-	0,728%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse Rosenheim-Bad Aibling	1,000%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	6.835.700	6.835.700	-	0,645%	-	Banks	100,500	DE
Sparkasse Schaumburg	1,250%	25/10/2013	25/10/2018	EUR	6.897.400	6.897.400	-	0,884%	-	Banks	100,730	DE
Sparkasse zu Luebeck AG	1,236%	15/01/2013	15/01/2018	EUR	6.667.500	6.667.500	-	0,840%	-	Banks	100,000	DE
Sparkasse zu Luebeck AG	1,500%	03/09/2013	03/09/2018	EUR	6.585.600	6.585.600	-	0,936%	-	Banks	102,650	DE
Sponda OYJ	3,375%	09/10/2013	09/10/2018	EUR	202.671.000	202.671.000	-	1,656%	-	Real Estate	99,638	FI
SRV Group OYJ	5,000%	18/12/2013	18/12/2018	EUR	103.173.000	103.173.000	-	5,636%	-	Industrial Other	100,000	FI

Stad Mechelen	2,000%	27/12/2013	27/12/2018	EUR	2.471.410	2.471.410	-	0,343%	-	Government Regional	100,000	BE
STADA Arzneimittel AG	2,250%	05/06/2013	05/06/2018	EUR	458.108.000	458.108.000	-	1,183%	-	Pharmaceuticals	99,417	DE
Stadt Mainz	0,390%	19/11/2013	19/11/2018	EUR	169.198.750	169.198.750	8,50	0,063%	-	Government Regional	100,000	DE
Stadtparkasse Emmerich-Rees	1,600%	31/05/2013	31/05/2018	EUR	6.485.700	6.485.700	-	0,705%	-	Banks	100,000	DE
Stadtparkasse Moenchengladbach	1,250%	02/01/2013	02/01/2018	EUR	6.584.400	6.584.400	-	0,778%	-	Banks	99,760	DE
Stadtparkasse Moenchengladbach	1,100%	01/08/2013	01/08/2018	EUR	6.606.800	6.606.800	-	0,869%	-	Banks	98,800	DE
Standard Chartered PLC	1,625%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	1.679.812.500	1.679.812.500	-	0,604%	A-	Diversified Banks	99,506	GB
State of Hesse	1,000%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	34.178.500	34.178.500	-	0,173%	AA	Government Regional	99,800	DE
State of Hesse	1,000%	28/01/2013	26/01/2018	EUR	67.291.000	67.291.000	-	0,172%	AA	Government Regional	100,068	DE
State of Hesse	1,100%	12/02/2013	12/02/2018	EUR	67.314.000	67.314.000	-	0,175%	AA	Government Regional	99,975	DE
State of Hesse	1,030%	19/02/2013	19/02/2018	EUR	66.942.500	66.942.500	-	0,177%	AA	Government Regional	100,000	DE
State of Saxony-Anhalt	0,046%	13/03/2013	13/03/2018	EUR	64.853.000	64.853.000	6,26	0,041%	AA+	Government Regional	100,000	DE
Svensk Exportkredit AB	1,125%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	1.343.850.000	1.343.850.000	-	0,075%	AA+	Government Agencies	99,961	SE
Svenska Handelsbanken AB	0,586%	05/03/2013	05/03/2018	EUR	195.381.000	195.381.000	22,09	0,199%	-	Banks	100,000	SE
Svenska Handelsbanken AB	0,586%	05/03/2013	05/03/2018	EUR	65.127.000	65.127.000	30,35	0,282%	-	Banks	100,000	SE
Swedbank AB	0,487%	06/12/2013	06/12/2018	EUR	13.696.200	13.696.200	43,45	0,413%	-	Banks	100,000	SE
Swedbank AB	0,566%	02/07/2013	02/07/2018	EUR	13.019.400	13.019.400	47,17	0,450%	A+	Banks	100,000	SE
Swedbank AB	0,488%	22/08/2013	22/08/2018	EUR	66.791.000	66.791.000	40,25	0,380%	A+	Banks	100,000	SE
Swedbank AB	0,566%	02/07/2013	02/07/2018	EUR	13.019.400	13.019.400	47,16	0,450%	-	Banks	100,000	SE
Sympatex Holding GmbH	8,000%	03/12/2013	03/12/2018	EUR	17.680.260	17.680.260	-	19,027%	-	Apparel & Textile Products	100,000	DE
TAG Immobilien AG	5,125%	07/08/2013	07/08/2018	EUR	413.158.700	413.158.700	-	2,724%	-	Real Estate	100,000	DE
Thales SA	1,625%	20/03/2013	20/03/2018	EUR	647.090.000	647.090.000	-	0,380%	BBB+	Aerospace & Defense	99,824	FR
Trafigura Funding SA	5,250%	29/11/2013	29/11/2018	EUR	824.213.265	824.213.265	-	4,514%	-	Refining & Marketing	100,000	LU
UBISOFT Entertainment	3,038%	06/05/2013	06/05/2018	EUR	52.300.800	52.300.800	-	4,159%	-	Software & Services	100,000	FR
Unibail-Rodamco SE	1,875%	08/10/2013	08/10/2018	EUR	331.285.687	678.700.000	-	0,473%	A	Real Estate	99,712	FR

UniCredit Bank AG	3,000%	21/06/2013	20/07/2018	EUR	1.314.170	1.314.170	-	2,473%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,250%	08/01/2013	08/01/2018	EUR	13.069.800	13.069.800	-	0,648%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,624%	27/03/2013	27/03/2018	EUR	6.386.000	6.386.000	-	0,724%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,550%	08/07/2013	08/07/2018	EUR	10.294.000	10.294.000	-	0,751%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,050%	28/05/2013	28/05/2018	EUR	6.432.700	6.432.700	-	0,738%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,420%	04/06/2013	04/06/2018	EUR	65.352.500	65.352.500	-	0,653%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,250%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	13.573.700	13.573.700	-	0,658%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,220%	09/07/2013	30/06/2018	EUR	70.354.350	70.354.350	-	0,165%	AAA	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,920%	01/02/2013	01/02/2018	EUR	41.014.200	41.014.200	-	0,629%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,096%	25/04/2013	25/04/2018	EUR	13.007.400	13.007.400	15,80	0,206%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,150%	19/03/2013	20/04/2018	EUR	64.389.000	64.389.000	-	1,643%	-	Banks	101,500	DE
UniCredit Bank AG	2,300%	15/01/2013	19/01/2018	EUR	66.675.000	66.675.000	-	1,404%	-	Banks	101,500	DE
UniCredit Bank AG	1,240%	31/10/2013	31/10/2018	EUR	13.599.100	13.599.100	-	0,203%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,020%	22/11/2013	31/10/2018	EUR	7.175.405	7.175.405	-	0,204%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,080%	06/05/2013	07/05/2018	EUR	65.376.000	65.376.000	46,39	0,512%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,250%	16/08/2013	16/08/2018	EUR	39.956.100	39.956.100	-	0,189%	-	Banks	99,850	DE
UniCredit Bank AG	1,200%	04/07/2013	04/07/2018	EUR	2.325.942	6.460.950	-	0,804%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,250%	05/03/2013	05/03/2018	EUR	9.769.050	9.769.050	-	0,686%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,150%	04/04/2013	04/04/2018	EUR	12.876.600	12.876.600	-	0,685%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,253%	14/01/2013	15/12/2017	EUR	10.021.350	10.021.350	-	0,200%	-	Banks	97,010	DE
UniCredit Bank AG	1,500%	15/02/2013	15/02/2018	EUR	2.670.740	2.670.740	68,17	0,660%	BBB	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,970%	21/01/2013	22/01/2018	EUR	6.791.619	6.791.619	-	0,241%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	0,158%	27/08/2013	27/08/2018	EUR	66.939.000	66.939.000	6,83	0,116%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	1,370%	26/09/2013	29/08/2018	EUR	13.472.800	13.472.800	-	0,214%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank Austria AG	2,625%	30/01/2013	30/01/2018	EUR	1.018.027.500	1.018.027.500	-	1,239%	BBB	Banks	99,708	AT

UniCredit Bank Austria AG	1,250%	30/07/2013	30/07/2018	EUR	927.794.000	927.794.000	-	0,158%	-	Banks	99,390	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,600%	09/10/2013	09/10/2018	EUR	21.618.240	67.557.000	-	1,570%	-	Banks	101,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,500%	20/11/2013	20/11/2018	EUR	17.470.050	17.470.050	-	1,575%	-	Banks	101,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,330%	05/06/2013	05/06/2018	EUR	17.277.216	65.444.000	152,42	1,502%	-	Banks	101,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,500%	28/03/2013	28/03/2018	EUR	22.566.016	64.108.000	148,68	1,465%	-	Banks	101,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,080%	26/11/2013	27/12/2018	EUR	13.556.700	13.556.700	-	0,349%	-	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,800%	05/02/2013	05/02/2018	EUR	6.792.000	6.792.000	140,93	1,457%	-	Banks	100,500	AT
UniCredit Bank Ireland PLC	2,500%	31/01/2013	31/01/2018	EUR	119.543.600	119.543.600	65,04	0,628%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,400%	28/02/2013	28/02/2018	EUR	164.848.320	164.848.320	-	0,790%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,300%	17/09/2013	17/09/2018	EUR	133.546.000	133.546.000	-	0,913%	BBB-	Financial Services	100,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,000%	25/06/2013	25/06/2018	EUR	22.923.250	22.923.250	81,71	0,795%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,250%	28/02/2013	28/02/2018	EUR	48.407.840	48.407.840	72,76	0,706%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,500%	08/02/2013	08/02/2018	EUR	50.748.620	50.748.620	-	0,863%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,200%	17/12/2013	17/12/2018	EUR	111.420.360	111.420.360	-	0,929%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,250%	08/11/2013	08/11/2018	EUR	65.497.810	65.497.810	-	0,941%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,000%	26/11/2013	26/11/2018	EUR	135.567.000	135.567.000	74,52	0,723%	BBB-	Financial Services	100,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,000%	20/12/2013	20/12/2018	EUR	68.390.500	68.390.500	78,49	0,763%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit Bank Ireland PLC	2,250%	18/10/2013	18/10/2018	EUR	136.915.000	136.915.000	74,92	0,727%	BBB-	Financial Services	100,000	IE
UniCredit SpA	2,700%	04/06/2013	04/06/2018	EUR	686.126.748	686.126.748	152,97	1,508%	-	Banks	100,000	IT
UniCredit SpA	0,500%	06/05/2013	06/05/2018	EUR	140.187.064	216.014.072	94,60	1,243%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,750%	13/09/2013	13/09/2018	EUR	331.218.520	331.218.520	-	1,301%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,750%	04/10/2013	04/10/2018	EUR	153.418.589	153.418.589	-	1,543%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	3,000%	10/12/2013	10/12/2018	EUR	55.078	55.078	-	3,114%	-	Banks	100,000	IT
Vapo / Lahti Energia / Insta Group / Teknos Group / Hartela Yhiot / Myllyn Paras	2,250%	05/12/2013	05/12/2018	EUR	57.391.740	57.391.740	-	1,552%	-	Property & Casualty Insurance	99,972	FI

Veneto Banca SpA	4,680%	31/01/2013	06/01/2018	EUR	67.922.500	67.922.500	-	2,961%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	2,400%	18/02/2013	18/02/2018	EUR	5.424.151	40.060.200	-	3,143%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	2,000%	18/03/2013	18/03/2018	EUR	16.656.342	16.656.342	300,32	3,051%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	4,000%	14/03/2013	14/03/2018	EUR	2.601.680	2.601.680	-	3,170%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	4,000%	24/10/2013	24/10/2018	EUR	2.760.860	2.760.860	-	3,325%	-	Banks	100,000	IT
VGP NV	5,100%	06/12/2013	06/12/2018	EUR	102.721.500	102.721.500	-	2,951%	-	Real Estate	100,000	BE
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC	3,035%	21/02/2013	21/02/2018	EUR	1.320.000.000	1.320.000.000	-	4,625%	BB+	Government Development Banks	100,000	IE
Volksbank eG Konstanz	1,000%	10/04/2013	10/04/2018	EUR	6.530.800	6.530.800	-	0,627%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank eG Nienburg/Weser	1,500%	15/05/2013	15/05/2018	EUR	6.430.300	6.430.300	-	0,789%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Raiffeisenbank Bayern Mitte eG	1,250%	04/06/2013	04/06/2018	EUR	6.535.250	6.535.250	-	0,761%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Raiffeisenbank Bayern Mitte eG	1,200%	15/05/2013	15/05/2018	EUR	6.430.300	6.430.300	-	0,756%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Raiffeisenbank Bayern Mitte eG	1,400%	06/11/2013	06/11/2018	EUR	6.762.950	6.762.950	-	0,749%	-	Banks	99,000	DE
Volkskreditbank AG	1,500%	17/05/2013	17/05/2018	EUR	23.946.634	25.655.000	-	1,250%	-	Banks	100,000	AT
Vontobel Financial Products GmbH	3,000%	05/02/2013	08/02/2018	EUR	33.960.000	33.960.000	189,82	1,876%	-	Banks	100,000	DE
Vontobel Financial Products GmbH	2,625%	13/02/2013	01/03/2018	EUR	33.631.500	33.631.500	136,59	1,344%	-	Banks	100,000	DE
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	0,766%	03/04/2013	03/04/2018	EUR	25.690.400	25.690.400	180,92	1,787%	-	Banks	99,825	AT
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	0,671%	18/07/2013	18/07/2018	EUR	3.663.716	3.663.716	192,14	1,899%	-	Banks	100,000	AT
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	0,535%	27/12/2013	27/12/2018	EUR	4.818.905	4.818.905	187,07	1,849%	-	Banks	100,000	AT
Vranken-Pommery Monopole SA	4,000%	30/07/2013	30/07/2018	EUR	66.271.000	66.271.000	-	2,336%	-	Food & Beverage	100,000	FR
VR-Bank Rhein-Erft eG	1,000%	10/12/2013	10/12/2018	EUR	6.884.750	6.884.750	-	0,780%	-	Banks	100,000	DE
WEB Windenergie AG	4,000%	08/04/2013	08/04/2018	EUR	10.347.200	10.347.200	-	3,596%	-	Renewable Energy	100,000	AT
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,500%	13/06/2013	13/06/2018	EUR	66.632.500	66.632.500	-	0,514%	-	Banks	100,940	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,125%	09/01/2013	09/01/2018	EUR	65.345.000	65.345.000	-	0,475%	-	Banks	100,120	DE

WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,139%	05/09/2013	05/09/2018	EUR	98.455.500	98.455.500	29,69	0,345%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,182%	08/08/2013	08/08/2018	EUR	66.956.000	66.956.000	40,89	0,387%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,170%	13/06/2013	13/06/2018	EUR	13.326.500	13.326.500	-	0,574%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,125%	29/04/2013	02/05/2018	EUR	65.425.000	65.425.000	-	0,496%	-	Banks	100,990	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,210%	19/04/2013	19/04/2018	EUR	65.338.000	65.338.000	32,43	0,372%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,353%	11/01/2013	11/01/2018	EUR	26.719.600	26.719.600	26,27	0,432%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	1,500%	20/09/2013	20/09/2018	EUR	202.897.500	202.897.500	-	0,466%	-	Banks	99,860	DE
Wienwert Immobilien Finanz AG	6,500%	23/04/2013	23/04/2018	EUR	13.010.500	13.010.500	-	1,268%	-	Real Estate	100,000	AT
Wienwert Immobilien Finanz AG	7,125%	01/10/2013	01/10/2018	EUR	6.762.500	6.762.500	-	1,295%	-	Real Estate	100,000	AT
Wirtschafts- und Infrastrukturbank Hessen	0,120%	19/04/2013	19/04/2018	EUR	26.135.200	26.135.200	1,63	0,064%	-	Banks	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1,250%	11/06/2013	11/06/2018	EUR	99.584.250	99.584.250	-	0,833%	AA-	Consumer Finance	100,660	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1,250%	16/04/2013	16/04/2018	EUR	131.735.000	131.735.000	-	0,808%	AA-	Consumer Finance	100,500	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,159%	16/07/2013	16/07/2018	EUR	39.430.800	39.430.800	69,02	0,738%	AA-	Consumer Finance	99,950	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,464%	21/08/2013	21/08/2018	EUR	40.121.100	40.121.100	57,51	0,744%	AA-	Consumer Finance	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1,500%	27/09/2013	27/09/2018	EUR	67.612.500	67.612.500	-	0,868%	AA-	Consumer Finance	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,231%	07/05/2013	07/05/2018	EUR	26.167.600	26.167.600	70,84	0,756%	AA-	Consumer Finance	99,950	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,189%	03/07/2013	03/07/2018	EUR	32.532.750	32.532.750	69,92	0,747%	AA-	Consumer Finance	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1,125%	04/04/2013	04/04/2018	EUR	38.629.800	38.629.800	-	0,854%	AA-	Consumer Finance	100,030	DE
Wuestenrot Bank AG Pfandbriefbank	1,500%	06/12/2013	06/12/2018	EUR	6.848.100	6.848.100	-	1,127%	-	Consumer Finance	99,700	DE

Emisión de Bonos en Europa en el año 2014– Fuente Bloomberg

Sociedad	Cupón	Fecha de inicio	Fecha de vencimiento	Div.	Nocional pendiente	Nocional inicial	Margen	Yield to Maturity (Mid)	S&P Rating	Industria	Precio	País
Banca di Credito Cooperativo di Triuggio e della Valle del Lambro SC	2,750%	13/01/2014	13/01/2019	EUR	6.827.050	6.827.050	-	2,027%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Triuggio e della Valle del Lambro SC	1,800%	21/07/2014	21/07/2019	EUR	6.760.300	6.760.300	-	2,083%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo di Triuggio e della Valle del Lambro SC	1,400%	01/09/2014	01/09/2019	EUR	9.191.560	9.191.560	-	2,117%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Laudense Lodi SC	1,400%	03/12/2014	03/12/2019	EUR	249.783	6.152.300	-	3,709%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Orobica di Bariano e Cologno Al Serio SCARL	1,850%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	6.004.442	6.909.600	-	1,910%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Picena SC/Castignano	2,300%	03/02/2014	03/02/2019	EUR	3.830.746	13.517.100	-	3,396%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Picena SC/Castignano	2,100%	16/06/2014	16/06/2019	EUR	780.269	6.784.950	-	3,506%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Picena SC/Castignano	2,000%	16/06/2014	16/06/2019	EUR	553.652	13.569.900	-	3,493%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo RovigoBanca SC	1,800%	18/08/2014	18/08/2019	EUR	1.392.310	6.680.950	-	2,277%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Sesto San Giovanni	2,500%	03/03/2014	03/03/2019	EUR	1.276.093	26.098.780	-	1,987%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Sesto San Giovanni	2,200%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	16.536.111	20.536.650	-	1,992%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Sesto San Giovanni	2,500%	12/05/2014	12/05/2019	EUR	11.659.142	13.757.100	-	1,973%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Vicentino Pojana Maggiore Vicenza SC	1,300%	20/11/2014	20/11/2019	EUR	7.523.280	7.523.280	-	3,644%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Vicentino Pojana Maggiore Vicenza SC	1,750%	12/02/2014	12/02/2019	EUR	1.348.981	6.792.450	-	3,533%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Vicentino Pojana Maggiore Vicenza SC	1,300%	25/09/2014	25/09/2019	EUR	7.644.480	7.644.480	-	3,609%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Credito Cooperativo Vicentino Pojana Maggiore Vicenza SC	1,750%	25/03/2014	25/03/2019	EUR	193.575	6.913.400	-	3,525%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Forli Credito Cooperativo SC	1,299%	03/06/2014	03/06/2019	EUR	18.309.253	40.899.300	166,63	1,714%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Imola SpA	1,750%	07/01/2014	07/01/2019	EUR	6.815	27.258.800	-	1,782%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Imola SpA	1,000%	15/07/2014	15/07/2019	EUR	7.622.278	7.622.278	143,09	1,600%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Imola SpA	1,375%	15/09/2014	15/09/2019	EUR	7.588.732	16.812.120	-	1,815%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Mantignana Credito Cooperativo Umbro SC	2,000%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	1.282.449	6.450.950	-	3,461%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Monastier e del Sile Credito Cooperativo-Societa Cooperativa	1,800%	30/10/2014	30/10/2019	EUR	680.902	25.218.600	-	3,877%	-	Banks	100,000	IT

Banca di Pescia Credito Cooperativo SC	2,750%	03/06/2014	03/06/2019	EUR	8.966.490	9.543.170	-	1,919%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Piacenza	2,200%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	16.439.960	34.494.250	-	1,851%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Piacenza	1,000%	01/08/2014	01/08/2019	EUR	8.015.680	8.015.680	-	1,908%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Pistoia Credito Cooperativo SC	3,000%	20/01/2014	20/01/2019	EUR	1.204.128	13.560.000	-	3,732%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Pistoia Credito Cooperativo SC	3,000%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	5.879.200	6.898.850	-	3,738%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Romano e S Caterina Credito Cooperativo SC	2,200%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	805.659	8.291.520	305,51	3,033%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Sassari SpA	1,000%	10/10/2014	10/10/2019	EUR	2.057.597	25.277.600	-	2,015%	-	Banks	100,000	IT
Banca di Udine Credito Cooperativo SC	1,750%	01/10/2014	01/10/2019	EUR	6.141.893	6.304.550	-	3,520%	-	Banks	100,000	IT
Banca IMI SpA	0,728%	31/07/2014	31/07/2019	EUR	16.838.833	16.838.833	160,17	1,580%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca IMI SpA	0,550%	19/02/2014	19/02/2019	EUR	15.643.128	15.643.128	150,79	1,486%	-	Financial Services	100,000	IT
Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	1,150%	12/12/2014	12/12/2019	EUR	10.298.373	62.278.500	-	3,479%	-	Banks	100,000	IT
Banca Malatestiana Credito Cooperativo SC	1,750%	24/04/2014	24/04/2019	EUR	30.449.244	41.470.800	-	3,304%	-	Banks	100,000	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	3,625%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	1.379.770.000	1.379.770.000	-	2,915%	-	Banks	99,457	IT
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	1,861%	12/05/2014	12/05/2019	EUR	96.519.814	96.519.814	208,09	2,129%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	2,750%	30/04/2014	30/04/2019	EUR	41.597.400	41.597.400	-	1,600%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	2,500%	25/03/2014	25/03/2019	EUR	41.480.400	41.480.400	-	1,583%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,000%	30/12/2014	30/12/2019	EUR	5.628.876	5.628.876	-	1,762%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	3,500%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	47.268.550	47.268.550	-	1,571%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,787%	29/08/2014	29/08/2019	EUR	7.056.129	7.056.129	147,11	1,449%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,785%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	8.668.340	8.668.340	148,62	1,464%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	1,000%	28/11/2014	28/11/2019	EUR	8.981.512	8.981.512	-	1,736%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	1,600%	31/10/2014	31/10/2019	EUR	11.104.074	11.104.074	-	1,714%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	1,035%	30/06/2014	30/06/2019	EUR	1.953.620	1.953.620	145,95	1,438%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	1,028%	31/07/2014	31/07/2019	EUR	1.543.337	1.543.337	145,71	1,435%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,737%	28/11/2014	28/11/2019	EUR	808.249	808.249	151,44	1,492%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	2,200%	17/03/2014	17/03/2019	EUR	7.380.197	7.380.197	-	1,604%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,837%	29/08/2014	29/08/2019	EUR	705.876	705.876	147,10	1,449%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,835%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	1.019.136	1.019.136	148,60	1,464%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nazionale del Lavoro SpA	0,735%	30/12/2014	30/12/2019	EUR	300.288	300.288	152,86	1,507%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nuova SpA	2,750%	09/05/2014	09/05/2019	EUR	1.639.966	13.758.100	-	4,060%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nuova SpA	2,750%	07/02/2014	07/02/2019	EUR	4.358.848	20.432.100	-	4,028%	-	Banks	100,000	IT

Banca Nuova SpA	2,750%	21/03/2014	21/03/2019	EUR	2.800.527	13.795.700	-	4,028%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nuova SpA	2,500%	11/07/2014	11/07/2019	EUR	599.914	13.603.500	-	4,111%	-	Banks	100,000	IT
Banca Nuova SpA	2,000%	07/11/2014	07/11/2019	EUR	590.558	8.702.960	-	4,149%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	2,500%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	5.110.668	13.797.700	-	4,105%	-	Banks	100,000	IT
Banca Padovana Credito Cooperativo SC	2,500%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	10.947.396	40.515.900	-	4,023%	-	Banks	100,000	IT
Banca Picena Truentina Credito Cooperativo Societa Cooperativa	2,000%	19/05/2014	19/05/2019	EUR	548.380	548.380	-	3,536%	-	Banks	100,000	IT
Banca Picena Truentina Credito Cooperativo Societa Cooperativa	0,000%	03/09/2014	03/09/2019	EUR	1.019.765	6.570.650	-	3,578%	-	Banks	100,000	IT
Banca Picena Truentina Credito Cooperativo Societa Cooperativa	2,000%	24/03/2014	24/03/2019	EUR	69.379	69.379	-	3,513%	-	Banks	100,000	IT
Banca Picena Truentina Credito Cooperativo Societa Cooperativa	1,300%	22/12/2014	22/12/2019	EUR	91.889	12.251.900	-	3,637%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Lazio Societa' Cooperativa per Azioni	2,200%	04/06/2014	04/06/2019	EUR	11.573.859	13.608.300	-	3,401%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Lazio Societa' Cooperativa per Azioni	2,500%	11/02/2014	11/02/2019	EUR	5.851.283	13.648.900	-	3,361%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Lazio Societa' Cooperativa per Azioni	2,200%	19/03/2014	19/03/2019	EUR	901.776	13.916.300	-	3,390%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Lazio Societa' Cooperativa per Azioni	1,750%	25/09/2014	25/09/2019	EUR	652.329	19.111.200	-	3,493%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare del Lazio Societa' Cooperativa per Azioni	1,750%	05/08/2014	05/08/2019	EUR	1.751.378	13.369.300	-	3,463%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Del Mezzogiorno SpA	2,200%	16/01/2014	16/01/2019	EUR	15.147.014	27.186.600	-	3,567%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Del Mezzogiorno SpA	1,400%	21/10/2014	21/10/2019	EUR	2.207.920	25.466.200	-	3,735%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Del Mezzogiorno SpA	2,200%	07/04/2014	07/04/2019	EUR	17.331.496	27.477.600	-	3,593%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Del Mezzogiorno SpA	2,000%	04/07/2014	04/07/2019	EUR	6.427.988	27.185.400	-	3,681%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Del Mezzogiorno SpA	1,900%	04/08/2014	04/08/2019	EUR	26.834.800	26.834.800	-	3,983%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Alto Adige SCpA Suedtiroler Volksbank Genossenschaft auf Akt	2,000%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	1.314.921	27.595.400	-	2,315%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Alto Adige SCpA Suedtiroler Volksbank Genossenschaft auf Akt	2,200%	04/03/2014	04/03/2019	EUR	9.713.634	41.200.200	-	2,275%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	2,200%	28/03/2014	28/03/2019	EUR	54.204.112	54.204.112	-	1,685%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	2,000%	19/06/2014	19/06/2019	EUR	84.830.342	84.830.342	-	1,715%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	1,400%	03/09/2014	03/09/2019	EUR	43.338.693	43.338.693	-	1,762%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	0,000%	19/05/2014	19/05/2019	EUR	41.128.500	41.128.500	-	1,626%	-	Banks	90,570	IT
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	1,200%	05/11/2014	05/11/2019	EUR	42.359.230	42.359.230	-	1,677%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Etruria e del Lazio SC	2,500%	16/05/2014	16/05/2019	EUR	7.678.601	7.678.601	-	2,018%	-	Banks	100,000	IT

Banca Popolare dell'Etruria e del Lazio SC	3,000%	06/02/2014	06/02/2019	EUR	6.818.282	6.818.282	-	1,997%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare dell'Etruria e del Lazio SC	3,000%	31/03/2014	31/03/2019	EUR	11.042.630	11.042.630	-	2,000%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Bari SCPa	5,500%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	17.964.960	17.964.960	-	3,478%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Cividale SCPA	4,000%	14/03/2014	14/03/2019	EUR	7.411.320	41.699.100	-	2,010%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Cividale SCPA	2,750%	19/12/2014	19/12/2019	EUR	771.139	14.688.360	-	2,163%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	4,250%	30/01/2014	30/01/2019	EUR	677.615.000	677.615.000	-	2,238%	B+	Banks	99,656	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	2,100%	30/05/2014	30/05/2019	EUR	19.882.049	19.882.049	-	2,244%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	1,000%	31/10/2014	31/10/2019	EUR	963.665	963.665	-	3,036%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	1,600%	31/07/2014	31/07/2019	EUR	2.616.846	2.616.846	-	2,369%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Milano Scarl	1,000%	29/08/2014	29/08/2019	EUR	1.077.874	1.077.874	-	2,388%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	2,000%	08/07/2014	08/07/2019	EUR	17.688.710	17.688.710	185,33	1,901%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	1,400%	09/09/2014	09/09/2019	EUR	14.547.178	16.790.670	-	2,001%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	2,100%	06/03/2014	06/03/2019	EUR	10.896.103	18.016.960	181,67	1,865%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Ravenna SpA	2,100%	07/05/2014	07/05/2019	EUR	18.095.740	18.095.740	183,16	1,880%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	1,375%	05/08/2014	05/08/2019	EUR	668.465.000	668.465.000	-	0,273%	-	Banks	99,976	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	2,250%	30/05/2014	30/05/2019	EUR	40.923.600	40.923.600	-	1,767%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	2,500%	14/03/2014	14/03/2019	EUR	42.394.085	42.394.085	-	1,728%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	1,500%	31/10/2014	31/10/2019	EUR	8.145.410	18.797.100	-	1,884%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	2,500%	11/04/2014	11/04/2019	EUR	54.199.470	54.199.470	-	1,739%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	2,500%	20/02/2014	20/02/2019	EUR	40.417.950	40.417.950	-	1,721%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	3,000%	24/01/2014	24/01/2019	EUR	34.207.500	34.207.500	-	1,716%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	1,800%	01/08/2014	01/08/2019	EUR	18.803.540	18.803.540	-	1,805%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Sondrio SCARL	0,000%	29/08/2014	29/08/2019	EUR	11.830.320	32.862.000	-	1,843%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	3,745%	21/03/2014	21/03/2019	EUR	413.871.000	413.871.000	-	3,720%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	4,000%	27/08/2014	27/08/2019	EUR	205.595.276	205.595.276	-	3,957%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	2,750%	03/02/2014	03/02/2019	EUR	12.788.528	40.551.300	-	4,269%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	2,500%	23/05/2014	23/05/2019	EUR	5.513.808	34.069.500	-	4,352%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	2,500%	11/07/2014	11/07/2019	EUR	2.988.689	20.405.250	-	4,404%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	2,750%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	4.612.849	34.548.000	-	3,967%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	2,000%	07/11/2014	07/11/2019	EUR	3.566.970	18.649.200	-	4,461%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	3,500%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	10.012.301	20.536.650	-	4,349%	-	Banks	100,000	IT

Banca Popolare di Vicenza	2,250%	22/08/2014	22/08/2019	EUR	3.834.188	3.834.188	-	4,414%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	3,295%	30/06/2014	30/06/2019	EUR	95.832.800	95.832.800	-	4,102%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	2,750%	24/02/2014	24/02/2019	EUR	9.523.515	41.209.500	-	4,286%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	3,620%	17/03/2014	17/03/2019	EUR	181.023.700	181.023.700	-	3,895%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	3,600%	30/04/2014	30/04/2019	EUR	69.329.000	69.329.000	-	4,147%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare di Vicenza	2,830%	31/07/2014	31/07/2019	EUR	66.927.000	66.927.000	-	4,181%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Etica Scpa	1,750%	14/01/2014	14/01/2019	EUR	9.074.632	9.074.632	-	1,660%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Friuladria SpA	1,400%	24/09/2014	24/09/2019	EUR	319.663	319.663	-	1,950%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Friuladria SpA	1,600%	10/01/2014	10/01/2019	EUR	3.020.934	3.020.934	-	1,843%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Friuladria SpA	2,500%	03/02/2014	03/02/2019	EUR	3.244.104	3.244.104	-	1,857%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Friuladria SpA	2,300%	10/03/2014	10/03/2019	EUR	1.387.400	1.387.400	-	1,874%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Friuladria SpA	2,000%	15/05/2014	15/05/2019	EUR	137.069	137.069	-	1,896%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Friuladria SpA	1,700%	23/06/2014	23/06/2019	EUR	679.810	679.810	-	1,894%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Friuladria SpA	1,700%	29/07/2014	29/07/2019	EUR	402.321	402.321	-	1,899%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,500%	06/06/2014	06/06/2019	EUR	245.495	6.819.300	-	3,529%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,800%	10/04/2014	10/04/2019	EUR	13.951.081	20.830.800	-	3,447%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,000%	07/07/2014	07/07/2019	EUR	3.025.863	20.408.250	-	3,522%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,700%	10/04/2014	10/04/2019	EUR	12.488.759	20.830.800	-	3,456%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,100%	07/02/2014	07/02/2019	EUR	20.432.100	20.432.100	-	3,394%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,000%	07/02/2014	07/02/2019	EUR	20.432.100	20.432.100	-	3,389%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	3,000%	10/03/2014	10/03/2019	EUR	20.811.000	20.811.000	-	3,415%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,900%	10/03/2014	10/03/2019	EUR	20.059.029	20.811.000	-	3,408%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,800%	09/01/2014	09/01/2019	EUR	6.363.682	20.374.650	-	3,411%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,500%	09/05/2014	09/05/2019	EUR	4.848.354	20.637.150	-	3,493%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	2,600%	09/05/2014	09/05/2019	EUR	3.984.346	20.637.150	-	3,485%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	1,900%	07/07/2014	07/07/2019	EUR	711.568	20.408.250	-	3,525%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	1,800%	05/08/2014	05/08/2019	EUR	1.227.302	20.053.950	-	3,551%	-	Banks	100,000	IT
Banca Popolare Pugliese Scpa	1,700%	05/08/2014	05/08/2019	EUR	1.135.054	20.053.950	-	3,535%	-	Banks	100,000	IT
Banca San Biagio del Veneto Orientale Banca di Credito Cooperativo SC	3,000%	15/01/2014	15/01/2019	EUR	6.500.603	13.593.900	-	1,978%	-	Banks	100,000	IT

Banca Santo Stefano Credito Cooperativo Martellago-Venezia SC	2,750%	07/01/2014	07/01/2019	EUR	1.362.940	13.629.400	-	3,485%	-	Banks	100,000	IT
Banca Sella SpA	1,500%	12/05/2014	12/05/2019	EUR	6.878.550	6.878.550	-	1,852%	-	Banks	100,000	IT
Banca Suasa - Credito Cooperativo SC	2,750%	02/07/2014	02/07/2019	EUR	1.852.549	6.825.900	-	3,699%	-	Banks	100,000	IT
Banca Suasa - Credito Cooperativo SC	2,750%	20/01/2014	20/01/2019	EUR	233.232	6.780.000	-	3,611%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	2,100%	03/11/2014	03/11/2019	EUR	303.395	24.970.800	-	1,997%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	2,800%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	15.187.537	27.382.200	-	1,901%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	3,000%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	2.886.479	27.595.400	-	1,894%	-	Banks	100,000	IT
Banca Valsabbina SCpA	2,400%	15/09/2014	15/09/2019	EUR	741.027	25.864.800	-	1,953%	-	Banks	100,000	IT
Banca Veronese Credito Cooperativo di Concamarise SC	1,300%	27/10/2014	27/10/2019	EUR	1.397.495	7.622.700	-	2,091%	-	Banks	100,000	IT
Bance di Credito Cooperativo di Busto Garolfo e Buguggiate	2,250%	29/01/2014	29/01/2019	EUR	27.319.800	27.319.800	-	3,777%	-	Banks	100,000	IT
Bance di Credito Cooperativo di Busto Garolfo e Buguggiate	1,500%	22/09/2014	22/09/2019	EUR	38.496.600	38.496.600	-	3,875%	-	Banks	100,000	IT
Bance di Credito Cooperativo di Busto Garolfo e Buguggiate	2,000%	19/05/2014	19/05/2019	EUR	13.709.500	13.709.500	-	3,906%	-	Banks	100,000	IT
Banco BPI SA	0,850%	31/12/2014	31/12/2019	EUR	31.459	31.459	-	1,982%	-	Banks	100,000	PT
Banco di Desio e della Brianza SpA	1,800%	22/12/2014	22/12/2019	EUR	61.259.500	61.259.500	406,23	4,110%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,419%	28/08/2014	28/08/2019	EUR	65.873.000	65.873.000	406,97	4,118%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	1,200%	15/09/2014	15/09/2019	EUR	15.211.089	15.211.089	-	4,021%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,250%	31/03/2014	31/03/2019	EUR	12.404.711	12.404.711	-	3,950%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	2,000%	07/05/2014	07/05/2019	EUR	9.230.219	9.230.219	-	3,987%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Desio e della Brianza SpA	0,800%	30/10/2014	30/10/2019	EUR	6.577.011	6.577.011	-	4,092%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	2,500%	01/10/2014	01/10/2019	EUR	20.233.823	20.233.823	-	1,857%	-	Banks	100,000	IT
Banco di Sardegna SpA	1,900%	20/06/2014	20/06/2019	EUR	17.491.016	17.491.016	-	1,781%	-	Banks	100,000	IT
Banco Mare Nostrum SA	3,125%	21/01/2014	21/01/2019	EUR	677.515.000	677.515.000	-	0,318%	-	Banks	99,872	ES
Banco Popolare SC	3,500%	14/03/2014	14/03/2019	EUR	1.737.462.500	1.737.462.500	-	2,433%	NR	Banks	99,635	IT
Banco Popolare SC	2,000%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	129.849.556	129.849.556	-	2,515%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,500%	12/05/2014	12/05/2019	EUR	15.131.434	15.131.434	-	2,425%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,282%	31/01/2014	11/01/2019	EUR	41.434.260	41.434.260	218,15	2,159%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,500%	01/12/2014	01/12/2019	EUR	61.506.183	61.506.183	-	3,026%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,500%	30/05/2014	30/05/2019	EUR	167.743.108	167.743.108	210,81	2,086%	-	Banks	100,000	IT

Banco Popolare SC	1,831%	31/07/2014	19/07/2019	EUR	34.561.103	34.561.103	223,33	2,211%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,431%	22/10/2014	21/10/2019	EUR	7.775.635	7.775.635	229,39	2,272%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,981%	30/04/2014	26/04/2019	EUR	173.562.378	173.562.378	219,70	2,175%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,941%	30/05/2014	16/05/2019	EUR	95.311.064	95.311.064	221,09	2,189%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,281%	31/01/2014	17/01/2019	EUR	45.242.755	45.242.755	218,42	2,162%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,186%	29/12/2014	19/12/2019	EUR	4.953.963	4.953.963	233,06	2,309%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,431%	22/10/2014	22/10/2019	EUR	4.841.409	4.841.409	229,49	2,273%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,936%	30/06/2014	24/06/2019	EUR	134.535.561	134.535.561	222,51	2,203%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,981%	30/04/2014	18/04/2019	EUR	82.348.986	82.348.986	220,38	2,182%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,981%	30/04/2014	17/04/2019	EUR	60.869.475	60.869.475	220,64	2,184%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,281%	31/01/2014	18/01/2019	EUR	92.173.673	92.173.673	216,96	2,148%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,831%	31/07/2014	17/07/2019	EUR	43.797.029	43.797.029	223,22	2,210%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,936%	30/06/2014	25/06/2019	EUR	294.261.458	294.261.458	221,91	2,197%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,286%	31/03/2014	13/03/2019	EUR	92.036.149	92.036.149	218,71	2,165%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,286%	31/03/2014	15/03/2019	EUR	233.926.647	233.926.647	216,23	2,140%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,291%	28/02/2014	14/02/2019	EUR	69.865.950	69.865.950	218,44	2,162%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,186%	29/12/2014	18/12/2019	EUR	3.128.178	3.128.178	233,02	2,308%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,286%	31/03/2014	14/03/2019	EUR	84.055.101	84.055.101	218,87	2,167%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,291%	28/02/2014	15/02/2019	EUR	69.865.950	69.865.950	218,48	2,163%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	2,291%	28/02/2014	13/02/2019	EUR	57.618.698	57.618.698	218,73	2,165%	-	Banks	100,000	IT
Banco Popolare SC	1,941%	30/05/2014	17/05/2019	EUR	196.310.509	196.310.509	220,23	2,180%	-	Banks	100,000	IT
Banco Santander Totta SA	1,625%	11/06/2014	11/06/2019	EUR	1.015.162.500	1.015.162.500	-	0,433%	-	Banks	99,591	PT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	0,731%	23/01/2014	23/01/2019	EUR	6.837.550	6.837.550	139,20	1,370%	-	Banks	100,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	0,660%	12/11/2014	12/11/2019	EUR	4.975.600	4.975.600	-	0,660%	-	Banks	100,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	0,750%	11/09/2014	11/09/2019	EUR	12.939.500	12.939.500	-	1,283%	-	Banks	100,000	AT
Bank fuer Tirol und Vorarlberg AG	1,500%	03/01/2014	03/01/2019	EUR	13.605.000	13.605.000	-	1,224%	-	Banks	100,000	AT
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1,000%	19/03/2014	19/03/2019	EUR	2.087.445.000	2.087.445.000	-	0,075%	AA+	Government Development Banks	99,429	NL
Bank Nederlandse Gemeenten NV	0,375%	14/10/2014	14/10/2019	EUR	633.010.000	633.010.000	-	0,145%	AA+	Government Development Banks	99,936	NL
Bank of Ireland	3,250%	15/01/2014	15/01/2019	EUR	1.019.542.500	1.019.542.500	-	1,103%	BBB-	Banks	99,605	IE

Bank of Ireland Mortgage Bank	1,750%	19/03/2014	19/03/2019	EUR	1.043.722.500	1.043.722.500	-	0,384%	-	Banks	99,668	IE
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,706%	20/03/2014	20/03/2019	EUR	2.080.296.800	2.080.296.800	40,72	0,385%	A	Banks	99,852	FR
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,657%	28/05/2014	28/05/2019	EUR	285.427.800	285.427.800	48,67	0,465%	A	Banks	99,951	FR
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,697%	07/02/2014	07/02/2019	EUR	13.621.400	13.621.400	44,66	0,495%	A	Banks	100,000	FR
Banque Internationale a Luxembourg SA	0,700%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	3.788.610	3.788.610	67,51	0,653%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,000%	07/11/2014	07/11/2019	EUR	1.864.920	1.864.920	-	0,861%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,100%	27/06/2014	27/06/2019	EUR	4.092.330	4.092.330	-	0,799%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,000%	27/02/2014	27/02/2019	EUR	6.855.450	6.855.450	66,70	0,645%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,000%	28/03/2014	28/03/2019	EUR	6.876.600	6.876.600	66,57	0,644%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	0,800%	31/07/2014	31/07/2019	EUR	2.677.080	2.677.080	61,39	0,592%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	0,600%	02/12/2014	02/12/2019	EUR	2.477.260	2.477.260	64,58	0,624%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,450%	16/04/2014	16/04/2019	EUR	13.830.600	13.830.600	-	0,784%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,000%	22/05/2014	22/05/2019	EUR	9.555.210	9.555.210	66,33	0,641%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	0,800%	29/08/2014	29/08/2019	EUR	2.628.960	2.628.960	66,99	0,648%	-	Banks	100,000	LU
Banque Internationale a Luxembourg SA	1,250%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	17.556.890	17.556.890	-	0,772%	-	Banks	100,000	LU
Barclays Bank PLC	0,542%	07/05/2014	07/05/2019	EUR	278.396.000	278.396.000	66,53	0,643%	-	Banks	100,000	GB
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	1,093%	06/02/2014	06/02/2019	EUR	13.601.200	13.601.200	151,12	1,489%	-	Banks	100,000	AT
Bayerische Landesbank	0,600%	16/09/2014	16/09/2019	EUR	259.298.000	259.298.000	-	0,740%	-	Banks	99,930	DE
Bayerische Landesbank	1,100%	09/05/2014	09/05/2019	EUR	275.162.000	275.162.000	-	0,746%	-	Banks	99,980	DE
Bayerische Landesbank	0,800%	11/07/2014	11/07/2019	EUR	272.070.000	272.070.000	-	0,772%	-	Banks	99,790	DE
Bayerische Landesbank	0,850%	08/08/2014	08/08/2019	EUR	268.318.000	268.318.000	-	0,783%	-	Banks	99,950	DE
Bayerische Landesbank	0,314%	02/09/2014	02/09/2019	EUR	262.510.000	262.510.000	49,83	0,546%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	3,450%	13/08/2014	13/08/2019	EUR	66.856.000	66.856.000	-	3,181%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,125%	10/04/2014	10/04/2019	EUR	277.744.000	277.744.000	-	0,735%	-	Banks	99,920	DE
Bayerische Landesbank	0,600%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	129.019.000	129.019.000	-	0,799%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	3,400%	13/08/2014	12/08/2019	EUR	66.856.000	66.856.000	-	3,094%	-	Banks	100,000	DE
Bayerische Landesbank	1,000%	18/03/2014	18/03/2019	EUR	139.219.000	139.219.000	71,72	0,695%	-	Banks	100,750	DE
BBVA Senior Finance SAU	2,375%	22/01/2014	22/01/2019	EUR	1.355.100.000	1.355.100.000	-	0,709%	BBB	Banks	99,749	ES
BCC Pieve di Sacco SCRL	1,900%	15/09/2014	15/09/2019	EUR	19.398.600	19.398.600	-	3,470%	-	Banks	100,000	IT
BCC Pieve di Sacco SCRL	2,300%	03/03/2014	03/03/2019	EUR	8.727.981	20.604.300	-	3,392%	-	Banks	100,000	IT

Belfius Bank SA/NV	1,250%	28/01/2014	28/01/2019	EUR	819.792.000	819.792.000	-	0,192%	AAA	Banks	99,913	BE
Belfius Bank SA/NV	1,000%	11/02/2014	11/02/2019	EUR	20.473.350	20.473.350	-	0,292%	AAA	Banks	99,463	BE
Belfius Bank SA/NV	1,410%	10/07/2014	10/07/2019	EUR	4.419.188	4.419.188	-	0,907%	-	Banks	100,000	BE
Belfius Financing Co	1,700%	07/02/2014	07/02/2019	EUR	95.486.014	95.486.014	-	1,664%	-	Banks	100,000	LU
Belfius Financing Co	1,650%	07/01/2014	07/01/2019	EUR	80.481.607	80.481.607	-	1,662%	-	Banks	100,000	LU
Belgium Government Retail Bond	0,600%	04/06/2014	04/06/2019	EUR	8.154.093	8.154.093	-	0,050%	-	Sovereigns	100,000	BE
Berlin Hyp AG	1,625%	29/01/2014	29/01/2019	EUR	1.024.492.500	1.024.492.500	-	0,585%	-	Consumer Finance	99,814	DE
Berlin Hyp AG	0,625%	24/06/2014	24/06/2019	EUR	1.018.995.000	1.018.995.000	-	0,084%	-	Consumer Finance	99,623	DE
Berlin Hyp AG	0,875%	04/07/2014	04/07/2019	EUR	6.796.350	6.796.350	-	0,559%	-	Consumer Finance	100,190	DE
Berlin Hyp AG	1,500%	21/01/2014	21/01/2019	EUR	13.550.300	13.550.300	-	0,588%	-	Consumer Finance	100,010	DE
BGL BNP Paribas SA	0,681%	16/04/2014	16/04/2019	EUR	414.918.000	414.918.000	41,45	0,392%	A+	Banks	100,000	LU
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	0,730%	13/01/2014	13/01/2019	EUR	213.004	27.308.200	188,66	1,865%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	1,750%	12/03/2014	12/03/2019	EUR	7.645.205	20.854.350	193,02	1,908%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	2,250%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	19.134.650	34.494.250	-	1,955%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	1,250%	02/12/2014	01/12/2019	EUR	2.499.555	37.158.900	-	2,122%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	1,750%	22/04/2014	22/04/2019	EUR	1.320.660	13.800.000	-	1,993%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	0,481%	22/04/2014	22/04/2019	EUR	75.900	27.600.000	185,81	1,836%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	2,000%	12/03/2014	12/03/2019	EUR	638.143	20.854.350	197,10	1,949%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	2,500%	24/01/2014	24/01/2019	EUR	6.305.126	27.366.000	-	1,955%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	1,500%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	9.278.458	9.278.458	-	2,002%	-	Banks	100,000	IT
Biverbanca Cassa Risparmio Biella e Vercelli	1,500%	20/08/2014	20/08/2019	EUR	6.801.924	33.225.500	-	2,032%	-	Banks	100,000	IT
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	0,900%	30/01/2014	30/01/2019	EUR	3.726.883	3.726.883	70,56	0,684%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	0,650%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	1.768.858	1.768.858	66,38	0,642%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	0,700%	06/03/2014	06/03/2019	EUR	4.030.255	4.030.255	67,59	0,654%	-	Banks	100,000	NL
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	1,100%	30/04/2014	30/04/2019	EUR	693.290.000	693.290.000	-	0,817%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	1,000%	03/06/2014	03/06/2019	EUR	681.655.000	681.655.000	-	0,737%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	1,100%	09/04/2014	09/04/2019	EUR	690.465.000	690.465.000	-	0,806%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	3,000%	26/02/2014	29/03/2019	EUR	68.357.500	68.357.500	-	3,010%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH	1,400%	04/02/2014	04/02/2019	EUR	67.606.500	67.606.500	-	0,829%	-	Banks	100,000	DE
BNP Paribas Home Loan SFH SA	1,000%	25/02/2014	25/02/2019	EUR	1.375.220.000	1.375.220.000	-	0,101%	AAA	Financial Services	99,487	FR
BNP Paribas SA	0,539%	20/05/2014	20/05/2019	EUR	1.026.697.500	1.026.697.500	30,48	0,283%	A+	Diversified Banks	99,851	FR

BNP Paribas SA	0,687%	11/03/2014	11/03/2019	EUR	346.610.000	346.610.000	42,27	0,401%	A+	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,000%	29/04/2014	29/04/2019	EUR	828.672	828.672	65,38	0,632%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,800%	30/01/2014	30/01/2019	EUR	1.355.230	1.355.230	-	0,776%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,000%	30/05/2014	30/05/2019	EUR	1.309.555	1.309.555	64,72	0,625%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,300%	07/01/2014	07/01/2019	EUR	2.943.950	2.943.950	74,59	0,724%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,250%	24/04/2014	24/04/2019	EUR	5.875.030	5.875.030	69,57	0,674%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,530%	29/07/2014	29/07/2019	EUR	26.821.400	26.821.400	50,18	0,480%	A+	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,651%	24/01/2014	24/01/2019	EUR	205.245.000	205.245.000	49,56	0,474%	A+	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,250%	21/03/2014	21/03/2019	EUR	5.173.388	5.173.388	70,83	0,686%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,200%	16/06/2014	16/06/2019	EUR	3.237.778	3.237.778	68,18	0,660%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,750%	29/07/2014	29/07/2019	EUR	2.011.605	2.011.605	60,04	0,578%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,600%	30/07/2014	30/07/2019	EUR	1.386.075	1.386.075	58,26	0,561%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,300%	11/09/2014	11/09/2019	EUR	1.217.607	1.217.607	61,41	0,592%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	0,880%	27/02/2014	27/02/2019	EUR	6.855.450	6.855.450	66,58	0,644%	-	Diversified Banks	100,000	FR
BNP Paribas SA	1,500%	06/05/2014	06/05/2019	EUR	6.962.550	6.962.550	-	0,705%	-	Diversified Banks	100,170	FR
BPCE SA	1,375%	22/05/2014	22/05/2019	EUR	2.047.545.000	2.047.545.000	-	0,665%	A	Banks	99,842	FR
BPCE SA	0,731%	12/02/2014	12/02/2019	EUR	271.698.000	271.698.000	38,88	0,367%	A	Banks	100,000	FR
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,656%	20/05/2014	20/05/2019	EUR	68.446.500	68.446.500	39,67	0,445%	-	Banks	101,750	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,067%	11/09/2014	11/09/2019	EUR	129.395.000	129.395.000	5,25	0,031%	-	Banks	99,750	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,800%	16/09/2014	16/09/2019	EUR	64.824.500	64.824.500	-	0,827%	-	Banks	100,030	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,308%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	69.096.000	69.096.000	39,72	0,445%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,328%	01/08/2014	01/08/2019	EUR	67.155.500	67.155.500	39,53	0,443%	-	Banks	100,000	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,650%	07/08/2014	31/07/2019	EUR	133.504.000	133.504.000	-	0,322%	-	Banks	99,975	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	0,370%	13/11/2014	13/11/2019	EUR	62.325.000	62.325.000	-	0,252%	-	Banks	99,910	DE
Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,260%	14/02/2014	12/02/2019	EUR	68.476.500	68.476.500	-	0,735%	-	Banks	99,975	DE

Bremer Landesbank Kreditanstalt Oldenburg - Girozentrale	1,250%	12/03/2014	12/03/2019	EUR	69.514.500	69.514.500	-	0,745%	-	Banks	100,000	DE
British Telecommunications PLC	1,125%	10/06/2014	10/06/2019	EUR	1.354.580.000	1.354.580.000	-	0,617%	BBB	Wireline Telecommunications Services	99,508	GB
CA Animation	4,800%	25/03/2014	25/03/2019	EUR	48.393.800	48.393.800	-	4,208%	-	Supermarkets & Pharmacies	100,000	LU
Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA	1,125%	22/04/2014	22/04/2019	EUR	2.070.000.000	2.070.000.000	-	0,140%	-	Banks	99,947	FR
Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA	0,225%	29/01/2014	29/01/2019	EUR	13.659.900	13.659.900	31,04	0,288%	-	Banks	100,000	FR
Caisse Federale du Credit Mutuel Nord Europe SAC	0,699%	30/07/2014	30/07/2019	EUR	401.373.000	401.373.000	54,12	0,519%	A	Banks	99,850	FR
Caisse Francaise de Financement Local	0,375%	16/09/2014	16/09/2019	EUR	1.815.086.000	1.815.086.000	-	0,174%	AA+	Government Agencies	99,669	FR
Caixa Geral de Depositos SA	3,000%	15/01/2014	15/01/2019	EUR	1.019.542.500	1.019.542.500	-	0,416%	-	Banks	99,452	PT
Cassa Raiffeisen di Naturno SC	2,250%	17/02/2014	17/02/2019	EUR	6.848.250	6.848.250	-	1,912%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Raiffeisen Merano SC	1,300%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	6.450.950	6.450.950	-	3,474%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Raiffeisen Merano SC	0,750%	26/05/2014	26/05/2019	EUR	10.916.320	10.916.320	318,80	3,236%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Risparmio Fossano	3,250%	01/08/2014	01/08/2019	EUR	26.862.200	26.862.200	-	2,091%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Alta ValdiSole e Pejo BCC SC	1,200%	01/12/2014	01/12/2019	EUR	2.191.518	6.247.200	-	2,215%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Bolzano SC	0,549%	15/06/2014	15/06/2019	EUR	427.452	427.452	131,79	1,366%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Fiemme Banca di Credito Cooperativo SC	2,250%	05/05/2014	05/05/2019	EUR	16.651.680	16.651.680	-	3,382%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Tassullo e Nanno Banca di Credito Cooperativo SC	2,200%	03/02/2014	03/02/2019	EUR	2.018.103	6.758.550	-	3,629%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Tuenno-Val di Non Banca di Credito Cooperativo SC	2,150%	17/01/2014	17/01/2019	EUR	9.472.260	9.472.260	-	1,917%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale di Tuenno-Val di Non Banca di Credito Cooperativo SC	1,850%	01/05/2014	01/05/2019	EUR	11.094.160	11.094.160	-	1,948%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana Banca di Credito Cooperativo di Battipaglia SC	3,200%	10/06/2014	10/06/2019	EUR	13.545.800	13.545.800	-	2,216%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Binasco Credito Cooperativo SC	2,400%	13/01/2014	13/01/2019	EUR	2.930.170	6.827.050	-	1,947%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Binasco Credito Cooperativo SC	2,300%	12/02/2014	12/02/2019	EUR	3.957.281	13.584.900	-	1,947%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Ed Artigiana di Binasco Credito Cooperativo SC	2,100%	03/03/2014	03/03/2019	EUR	2.186.803	13.736.200	-	1,956%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	2,000%	02/01/2014	02/01/2019	EUR	8.073.543	20.512.050	-	3,373%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	1,750%	17/02/2014	17/02/2019	EUR	20.544.750	20.544.750	-	3,344%	-	Banks	100,000	IT

Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola Credito Cooperativo SC	1,500%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	12.694.388	27.382.200	-	3,445%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Giudicarie Valsabbia Paganella SC	2,250%	05/05/2014	05/05/2019	EUR	6.938.200	6.938.200	-	1,962%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Lavis-Valle di Cembra Banca Credito Cooperativo SC	2,250%	03/02/2014	03/02/2019	EUR	27.034.200	27.034.200	-	3,336%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Lavis-Valle di Cembra Banca Credito Cooperativo SC	2,000%	07/04/2014	07/04/2019	EUR	16.692.642	27.477.600	-	3,423%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Lavis-Valle di Cembra Banca Credito Cooperativo SC	1,800%	20/06/2014	20/06/2019	EUR	7.467.235	20.376.300	-	3,477%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Pinetana Fornace e Seregnano Banca di Credito Cooperativo Societa C	1,800%	05/05/2014	05/05/2019	EUR	9.225.031	9.713.480	-	3,891%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Pinetana Fornace e Seregnano Banca di Credito Cooperativo Societa C	1,200%	15/09/2014	15/09/2019	EUR	6.466.200	6.466.200	-	3,985%	-	Banks	100,000	IT
Cassa Rurale Valli di Primiero e Vanoi Banca di Credito SC	1,377%	02/05/2014	02/05/2019	EUR	13.863.800	13.863.800	341,36	3,392%	-	Banks	100,000	IT
Cie de Financement Foncier SA	1,125%	11/03/2014	11/03/2019	EUR	1.386.440.000	1.386.440.000	-	0,132%	AAA	Consumer Finance	99,879	FR
Cie de Financement Foncier SA	0,375%	17/09/2014	17/09/2019	EUR	1.295.130.000	1.295.130.000	-	0,179%	AAA	Consumer Finance	99,655	FR
CIN - Corp Industrial do Norte SA	3,399%	19/12/2014	19/12/2019	EUR	24.480.600	24.480.600	387,68	3,925%	-	Chemicals	100,000	PT
City of Amsterdam Netherlands	0,406%	11/12/2014	11/12/2019	EUR	49.547.200	49.547.200	-	0,085%	-	Government Regional	100,000	NL
CNH Industrial Finance Europe SA	2,750%	18/03/2014	18/03/2019	EUR	1.392.190.000	1.392.190.000	-	2,602%	BB+	Automobiles Manufacturing	99,471	LU
Commerzbank AG	0,375%	29/09/2014	30/09/2019	EUR	1.269.740.000	1.269.740.000	-	0,113%	-	Banks	99,672	DE
Commerzbank AG	1,000%	05/02/2014	05/02/2019	EUR	676.670.000	676.670.000	-	0,051%	-	Banks	99,531	DE
Commerzbank AG	1,250%	28/02/2014	28/02/2019	EUR	241.631.250	241.631.250	-	0,660%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	1,250%	26/03/2014	26/03/2019	EUR	248.196.600	248.196.600	-	0,669%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,791%	24/01/2014	24/01/2019	EUR	47.890.500	47.890.500	57,49	0,553%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,500%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	10.102.960	10.102.960	-	0,762%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,500%	31/10/2014	31/10/2019	EUR	10.025.120	10.025.120	-	0,781%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,689%	20/02/2014	20/02/2019	EUR	13.701.000	13.701.000	59,21	0,570%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,600%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	10.952.880	10.952.880	-	0,726%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,500%	02/12/2014	02/12/2019	EUR	4.335.205	4.335.205	-	0,800%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,350%	30/12/2014	30/12/2019	EUR	1.215.740	1.215.740	-	0,817%	BBB+	Banks	100,000	DE
Commerzbank AG	0,600%	02/09/2014	02/09/2019	EUR	13.125.500	13.125.500	-	0,745%	BBB+	Banks	100,500	DE
Commerzbank AG	0,800%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	8.899.215	8.899.215	-	0,726%	BBB+	Banks	100,000	DE

Comunidad Autonoma de Canarias	0,500%	18/12/2014	18/12/2019	EUR	61.419.000	61.419.000	-	1,470%	-	Government Local	100,000	ES
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands	1,750%	22/01/2014	22/01/2019	EUR	2.032.650.000	2.032.650.000	-	0,493%	A+	Banks	99,541	NL
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands	0,486%	20/03/2014	20/03/2019	EUR	1.377.680.000	1.377.680.000	25,00	0,228%	A+	Banks	99,901	NL
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands	0,467%	04/03/2014	04/03/2019	EUR	164.800.800	164.800.800	27,04	0,248%	A+	Banks	100,000	NL
Corvallis Holding SpA	6,250%	30/12/2014	30/12/2019	EUR	9.725.920	9.725.920	-	1,227%	-	Software & Services	100,000	IT
Coswell SpA	6,800%	21/07/2014	21/07/2019	EUR	20.280.900	20.280.900	-	5,976%	-	Consumer Products	100,000	IT
Credit Agricole CIB Financial Solutions SA	1,000%	14/03/2014	14/03/2019	EUR	9.007.006	9.007.006	107,85	1,057%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole CIB Financial Solutions SA	0,900%	11/04/2014	11/04/2019	EUR	2.621.031	2.621.031	108,81	1,066%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole CIB Financial Solutions SA	0,000%	08/12/2014	28/11/2019	EUR	12.314.500	12.314.500	-	1,221%	-	Financial Services	94,960	FR
Credit Agricole CIB Financial Solutions SA	1,300%	19/03/2014	19/03/2019	EUR	1.391.630	1.391.630	114,71	1,125%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole CIB Financial Solutions SA	0,500%	08/09/2014	08/09/2019	EUR	1.293.430	1.293.430	109,28	1,071%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,000%	07/03/2014	07/03/2019	EUR	2.282.421	2.282.421	112,73	1,105%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	0,736%	17/03/2014	17/03/2019	EUR	5.709.209	5.709.209	99,73	0,975%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	0,600%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	6.845.550	6.845.550	102,78	1,006%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA	1,000%	28/03/2014	28/03/2019	EUR	2.035.474	2.035.474	112,88	1,107%	-	Financial Services	100,000	FR
Credit Agricole SA/London	0,651%	24/04/2014	24/04/2019	EUR	552.944.000	552.944.000	53,11	0,509%	A	Diversified Banks	100,000	GB
Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH	1,125%	06/02/2014	06/02/2019	EUR	2.312.204.000	2.312.204.000	-	0,115%	AAA	Banks	99,470	FR
Credit Suisse AG/Guernsey	1,000%	12/03/2014	12/03/2019	EUR	2.433.007.500	2.433.007.500	-	0,287%	-	Financial Services	99,429	GG
Credit Suisse AG/London	0,431%	16/10/2014	16/10/2019	EUR	1.282.530.000	1.282.530.000	46,56	0,444%	A	Banks	99,750	GB
Credito Cooperativo di Brescia SC	2,500%	17/03/2014	10/04/2019	EUR	29.673.962	29.673.962	-	1,824%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo di Brescia SC	3,000%	10/01/2014	10/01/2019	EUR	40.232.659	40.989.600	-	1,776%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Interprovinciale Veneto SCARL	2,500%	02/01/2014	02/01/2019	EUR	38.590.003	41.024.100	-	3,213%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Interprovinciale Veneto SCARL	2,500%	01/08/2014	01/08/2019	EUR	67.155.500	67.155.500	-	3,223%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Interprovinciale Veneto SCARL	1,400%	22/09/2014	22/09/2019	EUR	30.704.888	30.704.888	-	3,342%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Interprovinciale Veneto SCARL	2,750%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	15.104.342	20.696.550	-	3,342%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Interprovinciale Veneto SCARL	2,250%	03/06/2014	03/06/2019	EUR	10.098.037	27.266.200	-	3,359%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Ravennate e Imolese SC	1,000%	15/12/2014	15/12/2019	EUR	14.056.976	16.168.880	166,24	1,710%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo Ravennate e Imolese SC	1,300%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	14.514.638	16.772.470	164,44	1,692%	-	Banks	100,000	IT
Credito Cooperativo di Brescia SC	0,800%	10/10/2014	10/10/2019	EUR	6.248.623	25.277.600	-	1,939%	-	Banks	100,000	IT

Credito di Romagna SpA	3,000%	03/06/2014	03/06/2019	EUR	385.817	385.817	319,57	3,244%	-	Banks	100,000	IT
Credito Emiliano SpA	1,875%	27/02/2014	27/02/2019	EUR	1.028.317.500	1.028.317.500	-	0,194%	-	Banks	99,858	IT
Credito Emiliano SpA	2,000%	28/02/2014	28/02/2019	EUR	69.037.500	69.037.500	-	1,552%	-	Banks	100,000	IT
Credito Emiliano SpA	1,500%	17/07/2014	17/07/2019	EUR	41.408.702	41.408.702	-	1,633%	-	Banks	100,000	IT
Credito Emiliano SpA	1,500%	19/05/2014	19/05/2019	EUR	39.864.484	39.864.484	-	1,600%	-	Banks	100,000	IT
Credito Emiliano SpA	1,800%	14/03/2014	14/03/2019	EUR	68.789.615	68.789.615	-	1,557%	-	Banks	100,000	IT
Credito Emiliano SpA	1,000%	31/07/2014	31/07/2019	EUR	21.554.510	21.554.510	-	1,643%	-	Banks	100,000	IT
Credito Emiliano SpA	1,000%	29/08/2014	29/08/2019	EUR	18.985.035	18.985.035	-	1,669%	-	Banks	100,000	IT
Credito Siciliano SpA	2,150%	11/07/2014	11/07/2019	EUR	11.127.663	20.405.250	-	3,534%	-	Banks	100,000	IT
Credito Siciliano SpA	1,400%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	9.521.602	19.352.850	-	3,570%	-	Banks	100,000	IT
Credito Siciliano SpA	2,250%	24/03/2014	24/03/2019	EUR	6.049.805	27.751.400	-	3,492%	-	Banks	100,000	IT
Credito Trevigiano Banca di Credito Cooperativo SC	1,610%	05/03/2014	05/03/2019	EUR	8.355.001	20.602.500	182,41	1,872%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	1,400%	12/09/2014	12/09/2019	EUR	12.973.500	12.973.500	-	3,671%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	2,250%	30/04/2014	30/04/2019	EUR	7.584.593	34.664.500	-	3,613%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	2,500%	04/03/2014	04/03/2019	EUR	41.571.002	41.571.002	-	3,462%	-	Banks	100,000	IT
Credito Valtellinese SC	2,200%	29/12/2014	29/12/2019	EUR	7.668.297	7.668.297	-	3,736%	-	Banks	100,000	IT
Criteria CaixaHolding SA	2,375%	09/05/2014	09/05/2019	EUR	1.375.810.000	1.375.810.000	-	1,410%	-	Financial Services	99,577	ES
Daimler AG	0,486%	24/06/2014	24/06/2019	EUR	407.598.000	407.598.000	20,56	0,184%	A-	Automobiles Manufacturing	100,000	DE
Danone SA	0,411%	09/05/2014	09/05/2019	EUR	206.371.500	206.371.500	24,93	0,227%	-	Food & Beverage	100,000	FR
Danske Bank A/S	0,581%	18/08/2014	19/08/2019	EUR	13.361.900	13.361.900	35,71	0,335%	-	Banks	100,000	DK
Danske Bank A/S	1,000%	27/08/2014	27/08/2019	EUR	32.982.000	32.982.000	-	0,970%	-	Banks	99,960	DK
Danske Bank A/S	0,496%	05/09/2014	05/09/2019	EUR	64.753.500	64.753.500	36,02	0,338%	-	Banks	100,000	DK
Danske Bank A/S	0,905%	20/08/2014	20/08/2019	EUR	11.961.180	11.961.180	51,29	0,491%	-	Banks	100,000	DK
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,400%	18/11/2014	18/11/2019	EUR	37.594.800	37.594.800	-	0,211%	-	Banks	99,920	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,036%	21/02/2014	25/03/2019	EUR	5.494.200	5.494.200	90,01	0,878%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,620%	23/12/2014	23/12/2019	EUR	12.175.700	12.175.700	-	0,631%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,390%	19/02/2014	19/02/2019	EUR	6.876.100	6.876.100	52,45	0,502%	-	Banks	100,450	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,206%	18/06/2014	18/06/2019	EUR	67.873.500	67.873.500	20,55	0,374%	A	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,316%	23/09/2014	23/09/2019	EUR	25.694.600	25.694.600	40,21	0,380%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,337%	09/12/2014	09/12/2019	EUR	16.111.810	16.111.810	39,49	0,373%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,309%	20/02/2014	20/02/2019	EUR	13.701.000	13.701.000	51,09	0,489%	-	Banks	100,000	DE

DekaBank Deutsche Girozentrale	0,311%	14/08/2014	14/08/2019	EUR	26.737.400	26.737.400	40,53	0,383%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,750%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	12.901.900	12.901.900	-	0,605%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,650%	28/11/2014	28/11/2019	EUR	62.173.000	62.173.000	-	0,625%	A	Banks	100,020	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,125%	18/02/2014	18/02/2019	EUR	68.769.500	68.769.500	-	0,627%	A	Banks	99,670	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,180%	22/07/2014	25/06/2019	EUR	13.467.000	13.467.000	-	0,894%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,580%	21/03/2014	25/03/2019	EUR	27.591.400	27.591.400	-	0,920%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,750%	02/04/2014	25/03/2019	EUR	13.766.400	13.766.400	-	1,204%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,050%	09/04/2014	25/03/2019	EUR	34.523.250	34.523.250	-	1,089%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,100%	16/06/2014	25/06/2019	EUR	5.427.960	5.427.960	-	0,791%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,500%	26/02/2014	25/03/2019	EUR	13.671.500	13.671.500	-	0,920%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	2,250%	12/03/2014	25/03/2019	EUR	13.902.900	13.902.900	-	1,171%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,640%	10/12/2014	10/12/2019	EUR	49.712.000	49.712.000	-	0,628%	A	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,125%	13/02/2014	13/02/2019	EUR	13.669.700	13.669.700	-	0,659%	-	Banks	99,710	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,160%	26/02/2014	26/02/2019	EUR	38.963.775	38.963.775	-	0,635%	A	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,250%	25/03/2014	25/03/2019	EUR	48.393.800	48.393.800	-	0,626%	A	Banks	100,440	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,500%	06/03/2014	06/03/2019	EUR	13.859.200	13.859.200	58,27	0,561%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,545%	28/11/2014	30/12/2019	EUR	12.434.600	12.434.600	74,75	0,725%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	1,250%	26/11/2014	30/12/2019	EUR	31.261.500	31.261.500	-	1,269%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,620%	17/11/2014	18/11/2019	EUR	62.241.000	62.241.000	60,32	0,581%	A	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,585%	29/12/2014	30/12/2019	EUR	24.343.800	24.343.800	68,96	0,668%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,392%	23/09/2014	23/09/2019	EUR	19.270.950	19.270.950	18,02	0,349%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,680%	18/09/2014	18/09/2019	EUR	58.153.500	58.153.500	-	0,607%	A	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,281%	05/03/2014	05/03/2019	EUR	27.470.000	27.470.000	39,57	0,444%	-	Banks	100,000	DE
DekaBank Deutsche Girozentrale	0,400%	17/09/2014	17/09/2019	EUR	12.951.300	12.951.300	-	0,608%	-	Banks	100,000	DE
Department of Seine-et-Marne France	0,615%	05/05/2014	05/05/2019	EUR	13.876.400	13.876.400	11,34	0,091%	-	Government Regional	100,000	FR
Deutsche Apotheker-und Aertztebank eG	0,625%	11/09/2014	11/09/2019	EUR	19.409.250	19.409.250	-	0,548%	AA-	Banks	99,990	DE
Deutsche Apotheker-und Aertztebank eG	0,212%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	12.901.900	12.901.900	34,71	0,325%	AA-	Banks	100,000	DE
Deutsche Apotheker-und Aertztebank eG	0,215%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	12.628.700	12.628.700	34,60	0,324%	AA-	Banks	100,000	DE
Deutsche Apotheker-und Aertztebank eG	0,500%	16/09/2014	16/09/2019	EUR	12.964.900	12.964.900	-	0,550%	AA-	Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,531%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	2.902.032.000	2.902.032.000	55,37	0,532%	BBB+	Diversified Banks	99,752	DE
Deutsche Bank AG	1,160%	27/05/2014	27/05/2019	EUR	34.040.000	34.040.000	-	0,757%	-	Diversified Banks	100,000	DE

Deutsche Bank AG	1,000%	09/04/2014	09/04/2019	EUR	7.457.022	7.457.022	-	1,282%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,310%	11/04/2014	11/04/2019	EUR	52.809.740	52.809.740	-	0,900%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,496%	25/06/2014	25/06/2019	EUR	20.457.300	20.457.300	58,25	0,560%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	1,110%	23/05/2014	23/05/2019	EUR	13.627.800	13.627.800	-	0,765%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,750%	02/10/2014	02/10/2019	EUR	12.675.600	12.675.600	-	0,800%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG	0,582%	08/05/2014	08/05/2019	EUR	41.583.600	41.583.600	60,45	0,583%	-	Diversified Banks	100,000	DE
Deutsche Bank AG/London	0,589%	20/05/2014	20/05/2019	EUR	616.018.500	616.018.500	67,72	0,655%	-	Banks	100,000	GB
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	0,700%	01/08/2014	01/08/2019	EUR	6.715.550	6.715.550	-	0,907%	A+	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	0,590%	25/07/2014	25/07/2019	EUR	13.428.800	13.428.800	-	0,110%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	0,510%	27/08/2014	27/08/2019	EUR	13.192.800	13.192.800	-	0,119%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	0,625%	29/07/2014	29/07/2019	EUR	670.535.000	670.535.000	-	0,086%	-	Consumer Finance	99,917	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,250%	25/02/2014	25/02/2019	EUR	13.752.200	13.752.200	-	0,667%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Deutsche Hypothekenbank AG	1,000%	04/07/2014	04/07/2019	EUR	33.981.750	33.981.750	-	0,677%	-	Consumer Finance	100,210	DE
Deutsche Kreditbank AG	1,135%	30/01/2014	30/01/2019	EUR	13.552.300	13.552.300	-	0,162%	-	Banks	99,955	DE
Deutsche Lufthansa AG	1,125%	12/09/2014	12/09/2019	EUR	648.675.000	648.675.000	-	1,145%	BBB-	Airlines	99,556	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,500%	17/09/2014	17/09/2019	EUR	647.565.000	647.565.000	-	1,715%	BBB	Banks	99,785	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,000%	25/03/2014	25/03/2019	EUR	1.037.010.000	1.037.010.000	-	0,085%	AA+	Banks	99,400	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	0,137%	11/09/2014	11/09/2019	EUR	323.487.500	323.487.500	7,98	0,058%	AA+	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	0,836%	18/12/2014	18/12/2019	EUR	13.143.666	13.143.666	153,64	1,514%	BBB	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,100%	09/12/2014	09/12/2019	EUR	15.492.125	15.492.125	173,42	1,712%	BBB	Banks	100,000	DE
Deutsche Pfandbriefbank AG	1,070%	15/12/2014	16/12/2019	EUR	6.218.800	6.218.800	167,20	1,650%	BBB	Banks	100,000	DE
Dexia Credit Local SA	0,381%	17/01/2014	17/01/2019	EUR	27.063.600	27.063.600	22,00	0,198%	AA	Banks	99,750	FR
Dexia Kommunalbank Deutschland AG	1,000%	11/06/2014	11/06/2019	EUR	676.775.000	676.775.000	-	0,115%	A	Consumer Finance	100,000	DE
DIC Asset AG	4,625%	08/09/2014	08/09/2019	EUR	226.350.250	226.350.250	-	3,418%	-	Real Estate	100,000	DE
DNB Bank ASA	0,525%	05/02/2014	05/02/2019	EUR	67.667.000	67.667.000	49,32	0,471%	A+	Banks	100,000	NO
DNB Boligkreditt AS	0,130%	29/01/2014	29/01/2019	EUR	1.365.990.000	1.365.990.000	6,01	0,038%	AAA	Banks	99,850	NO
DVB Bank SE	0,875%	11/11/2014	11/11/2019	EUR	623.180.000	623.180.000	-	0,903%	A+	Commercial Finance	99,534	DE
DVB Bank SE	1,250%	18/06/2014	18/06/2019	EUR	67.873.500	67.873.500	-	0,835%	A+	Commercial Finance	99,500	DE
DVB Bank SE	0,386%	16/09/2014	16/09/2019	EUR	97.236.750	97.236.750	35,00	0,328%	-	Commercial Finance	100,000	DE
DVB Bank SE	0,791%	18/02/2014	18/02/2019	EUR	68.769.500	68.769.500	70,92	0,687%	A+	Commercial Finance	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,010%	24/09/2014	25/09/2019	EUR	31.966.250	31.966.250	-	0,869%	-	Banks	100,000	DE

DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	1,400%	05/09/2014	25/09/2019	EUR	32.376.750	32.376.750	-	1,053%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,500%	10/06/2014	28/06/2019	EUR	13.545.800	13.545.800	-	0,439%	-	Banks	99,650	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,910%	18/12/2014	27/12/2019	EUR	30.709.500	30.709.500	-	0,883%	-	Banks	100,000	DE
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,600%	15/07/2014	15/07/2019	EUR	33.919.000	33.919.000	-	0,399%	-	Banks	100,000	DE
DZ Privatbank SA	0,400%	21/11/2014	21/11/2019	EUR	61.941.000	61.941.000	-	0,732%	-	Banks	99,837	LU
EDP Finance BV	2,625%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	898.248.000	898.248.000	-	1,303%	BB+	Utilities	99,272	NL
Electrolux AB	1,000%	05/12/2014	05/12/2019	EUR	122.926.000	122.926.000	-	0,800%	BBB	Home Improvement	99,613	SE
Emil Banca Credito Cooperativo SC	2,500%	30/01/2014	30/01/2019	EUR	13.552.300	13.552.300	-	1,811%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	1,700%	11/08/2014	11/08/2019	EUR	26.771.000	26.771.000	-	1,891%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	2,250%	10/03/2014	10/03/2019	EUR	5.023.775	13.874.000	-	1,836%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	2,100%	10/04/2014	10/04/2019	EUR	13.887.200	13.887.200	-	1,834%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	2,500%	11/08/2014	11/08/2019	EUR	6.692.750	6.692.750	-	1,888%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	1,850%	26/05/2014	26/05/2019	EUR	18.885.234	27.290.800	-	1,850%	-	Banks	100,000	IT
Emil Banca Credito Cooperativo SC	3,000%	24/03/2014	24/03/2019	EUR	6.937.850	6.937.850	-	1,839%	-	Banks	100,000	IT
Emisora Santander Espana SAU	1,700%	27/05/2014	27/05/2019	EUR	136.160.000	136.160.000	-	0,849%	-	Banks	100,000	ES
Erste Group Bank AG	0,000%	21/05/2014	21/05/2019	EUR	1.366.280.000	1.366.280.000	10,88	0,087%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,050%	19/03/2014	19/03/2019	EUR	7.653.965	7.653.965	-	1,061%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	2,500%	29/12/2014	20/01/2020	EUR	1.764.926	1.764.926	-	1,161%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,200%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	9.453.710	9.453.710	-	1,059%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	0,050%	02/07/2014	02/07/2019	EUR	13.651.800	13.651.800	0,50	0,053%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,100%	12/03/2014	12/03/2019	EUR	1.042.718	1.042.718	-	1,095%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,100%	23/04/2014	23/04/2019	EUR	2.487.438	2.487.438	-	1,074%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,400%	19/02/2014	19/02/2019	EUR	5.363.358	5.363.358	-	1,071%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	0,788%	22/05/2014	22/05/2019	EUR	5.460.120	5.460.120	89,11	0,869%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,100%	02/04/2014	02/04/2019	EUR	1.927.296	1.927.296	-	1,081%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	0,671%	14/08/2014	14/08/2019	EUR	20.053.050	20.053.050	87,20	0,850%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,400%	29/01/2014	29/01/2019	EUR	5.122.463	5.122.463	-	1,074%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,250%	05/02/2014	05/02/2019	EUR	1.395.294	1.395.294	-	1,098%	-	Banks	100,000	AT
Erste Group Bank AG	1,250%	03/01/2014	03/01/2019	EUR	1.360.500	1.360.500	-	1,106%	-	Banks	100,000	AT
Estra SpA	5,000%	14/07/2014	14/07/2019	EUR	68.058.000	68.058.000	-	4,764%	-	Oil & Gas Services & Equipment	100,000	IT
F van Lanschot Bankiers NV	2,125%	21/02/2014	21/02/2019	EUR	4.395.360	4.395.360	-	1,206%	-	Banks	100,000	NL

FCA Capital Ireland PLC	2,625%	17/04/2014	17/04/2019	EUR	1.036.402.500	1.036.402.500	-	1,321%	BB+	Automobiles Manufacturing	99,502	IE
FCA Capital Ireland PLC	2,000%	23/09/2014	23/10/2019	EUR	963.547.500	963.547.500	-	1,525%	BB+	Automobiles Manufacturing	99,764	IE
FMS Wertmanagement AoER	0,750%	14/04/2014	14/03/2019	EUR	1.382.780.000	1.382.780.000	-	0,017%	AAA	Winding Up Agencies	99,569	DE
Fresenius Finance BV	2,375%	23/01/2014	01/02/2019	EUR	410.253.000	410.253.000	-	1,246%	BB+	Medical Equipment & Devices Manufacturing	99,647	NL
Fresenius Finance BV	2,375%	23/01/2014	01/02/2019	EUR	410.253.000	410.253.000	-	1,221%	BB+	Medical Equipment & Devices Manufacturing	99,647	NL
Gazprombank OJSC Via GPB Eurobond Finance PLC	4,000%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	1.369.110.000	1.369.110.000	-	5,614%	BB+	Banks	100,000	IE
Global System International SpA	6,750%	06/08/2014	06/08/2019	EUR	7.219.206	7.219.206	-	5,904%	-	Machinery Manufacturing	100,000	IT
GRENKE FINANCE Plc	2,170%	04/03/2014	04/03/2019	EUR	41.200.200	41.200.200	-	1,712%	BBB+	Commercial Finance	100,000	IE
Groupe Promeo	5,500%	12/12/2014	12/12/2019	EUR	18.758.284	18.758.284	-	4,510%	-	Real Estate	100,000	FR
Gruppo Bancario del Mediterraneo Holding SpA	4,500%	19/05/2014	19/05/2019	EUR	6.854.750	6.854.750	-	4,034%	-	Banks	100,000	IT
Hamburger Sparkasse AG	1,000%	10/04/2014	10/04/2019	EUR	27.774.400	27.774.400	-	0,187%	-	Banks	99,980	DE
Hamburger Sparkasse AG	0,950%	09/05/2014	09/05/2019	EUR	27.516.200	27.516.200	-	0,183%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,400%	15/01/2014	15/01/2019	EUR	13.679.542	67.969.500	-	0,744%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,050%	12/03/2014	12/03/2019	EUR	69.514.500	69.514.500	-	0,720%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	1,000%	12/03/2014	12/03/2019	EUR	63.469.519	69.514.500	-	0,721%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	0,850%	04/06/2014	04/06/2019	EUR	68.041.500	68.041.500	-	0,748%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	0,750%	02/06/2014	04/06/2019	EUR	1.101.227	67.977.000	-	0,775%	-	Banks	100,000	DE
Hamburger Sparkasse AG	0,500%	18/09/2014	18/09/2019	EUR	32.307.500	32.307.500	-	0,191%	-	Banks	99,980	DE
Hannoversche Volksbank	1,000%	01/10/2014	01/10/2019	EUR	6.304.550	6.304.550	-	0,827%	-	Banks	101,000	DE
Hannoversche Volksbank	1,250%	31/05/2014	31/05/2019	EUR	6.797.700	6.797.700	-	0,790%	-	Banks	100,750	DE
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	2,250%	12/03/2014	12/03/2019	EUR	695.145.000	695.145.000	-	1,437%	-	Construction Materials Manufacturing	98,839	LU
Hellenic Republic Government Bond	0,762%	11/08/2014	10/08/2019	EUR	993.408.898	993.408.898	1.661,68	16,665%	-	Sovereigns	100,000	GR
Hellenic Republic Government Bond	4,750%	17/04/2014	17/04/2019	EUR	5.570.083.052	5.570.083.052	-	17,509%	CCC+	Sovereigns	99,133	GR
Herbawi GmbH	7,750%	09/10/2014	09/10/2019	EUR	12.686.400	12.686.400	-	7,941%	-	Retail - Consumer Discretionary	100,000	DE
Hesalight A/S	7,000%	12/12/2014	12/12/2019	EUR	68.506.350	68.506.350	-	5,344%	-	Semiconductors	100,000	DK
HKScan OYJ	3,625%	21/11/2014	21/11/2019	EUR	123.882.000	123.882.000	-	3,032%	-	Food & Beverage	99,422	FI
HOCHTIEF AG	2,625%	28/05/2014	28/05/2019	EUR	679.590.000	679.590.000	-	1,743%	-	Industrial Other	99,423	DE
HSBC France SA	0,532%	11/07/2014	11/07/2019	EUR	68.017.500	68.017.500	55,40	0,532%	-	Banks	100,000	FR
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG	1,122%	26/03/2014	26/03/2019	EUR	13.788.700	13.788.700	-	0,813%	-	Banks	100,000	DE

HSH Finanzfonds AoeR	0,099%	12/06/2014	17/06/2019	EUR	677.335.000	677.335.000	4,99	0,098%	-	Government Regional	100,000	DE
HSH Nordbank AG	0,625%	17/07/2014	17/07/2019	EUR	676.215.000	676.215.000	-	0,131%	-	Banks	99,469	DE
HSH Nordbank AG	1,540%	16/07/2014	16/07/2019	EUR	243.509.400	243.509.400	-	0,878%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,000%	16/10/2014	16/10/2019	EUR	109.015.050	109.015.050	-	0,941%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	0,411%	04/11/2014	04/11/2019	EUR	6.272.600	6.272.600	35,29	0,401%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,000%	11/12/2014	11/12/2019	EUR	6.812.740	6.812.740	70,48	0,753%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,000%	16/10/2014	16/10/2019	EUR	3.847.590	3.847.590	-	0,941%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,330%	12/09/2014	11/10/2019	EUR	1.297.350	1.297.350	-	2,543%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	3,000%	31/10/2014	31/10/2019	EUR	1.879.710	1.879.710	-	0,941%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,280%	18/11/2014	18/11/2019	EUR	6.265.800	6.265.800	-	0,962%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	1,540%	16/07/2014	16/07/2019	EUR	22.998.110	22.998.110	-	0,882%	-	Banks	100,000	DE
HSH Nordbank AG	2,000%	02/01/2014	02/01/2019	EUR	1.640.964	1.640.964	-	0,923%	-	Banks	100,000	DE
HYPO NOE Gruppe Bank AG	1,125%	12/11/2014	12/11/2019	EUR	186.585.000	186.585.000	-	1,812%	A	Consumer Finance	99,966	AT
HYPO NOE Gruppe Bank AG	0,698%	06/08/2014	06/08/2019	EUR	1.336.890	1.336.890	154,22	1,520%	-	Consumer Finance	100,000	AT
HYPO NOE Gruppe Bank AG	0,109%	27/06/2014	27/06/2019	EUR	27.282.200	27.282.200	13,90	0,187%	-	Consumer Finance	100,000	AT
HYPO NOE Gruppe Bank AG	0,995%	15/05/2014	15/05/2019	EUR	10.965.520	10.965.520	-	0,424%	-	Consumer Finance	100,000	AT
HYPO NOE Landesbank AG	1,250%	01/02/2014	01/02/2019	EUR	6.758.550	6.758.550	39,71	0,445%	-	Consumer Finance	100,000	AT
Hypo Tirol Bank AG	0,500%	09/10/2014	09/10/2019	EUR	380.592.000	380.592.000	-	0,363%	-	Consumer Finance	99,577	AT
ICAP Group Holdings PLC	3,125%	06/03/2014	06/03/2019	EUR	485.072.000	485.072.000	-	2,362%	-	Financial Services	99,654	GB
Iccrea Banca SpA	1,875%	25/11/2014	25/11/2019	EUR	622.985.000	622.985.000	-	1,705%	BB	Banks	99,542	IT
Iccrea Banca SpA	2,000%	11/04/2014	11/04/2019	EUR	34.743.250	34.743.250	154,19	1,590%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	3,000%	20/01/2014	20/01/2019	EUR	67.800.000	67.800.000	-	1,499%	-	Banks	100,000	IT
Iccrea Banca SpA	1,000%	01/12/2014	01/12/2019	EUR	16.242.720	16.242.720	141,09	1,459%	-	Banks	100,000	IT
IKB Deutsche Industriebank AG	2,000%	01/12/2014	01/12/2019	EUR	12.494.400	12.494.400	-	0,888%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	2,650%	03/04/2014	03/04/2019	EUR	13.720.600	13.720.600	-	0,809%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	1,700%	28/10/2014	28/10/2019	EUR	12.738.900	12.738.900	-	0,869%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	2,600%	19/05/2014	19/05/2019	EUR	13.709.500	13.709.500	-	0,810%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	0,000%	03/04/2014	03/04/2019	EUR	13.720.600	13.720.600	-	0,802%	-	Consumer Finance	87,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	3,000%	26/02/2014	26/02/2019	EUR	13.671.500	13.671.500	-	0,813%	-	Consumer Finance	100,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	0,000%	04/07/2014	04/07/2019	EUR	13.592.700	13.592.700	-	0,819%	-	Consumer Finance	88,000	DE
IKB Deutsche Industriebank AG	2,800%	20/01/2014	20/01/2019	EUR	13.560.000	13.560.000	-	0,811%	-	Consumer Finance	100,500	DE

INEOS Grangemouth PLC	0,750%	30/07/2014	30/07/2019	EUR	381.304.350	381.304.350	-	0,258%	-	Chemicals	99,688	GB
ING Bank NV	0,399%	20/11/2014	20/11/2019	EUR	626.940.000	626.940.000	36,56	0,344%	-	Banks	100,523	NL
ING Bank NV	0,578%	25/02/2014	25/02/2019	EUR	275.044.000	275.044.000	33,33	0,311%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,000%	30/01/2014	30/01/2019	EUR	13.552.300	13.552.300	60,85	0,586%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,000%	11/03/2014	11/03/2019	EUR	20.796.600	20.796.600	59,30	0,571%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,125%	27/05/2014	27/05/2019	EUR	68.080.000	68.080.000	-	0,700%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	0,750%	30/01/2014	30/01/2019	EUR	650.510	650.510	62,57	0,604%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,250%	31/03/2014	29/03/2019	EUR	1.377.230	1.377.230	-	0,712%	-	Banks	100,000	NL
ING Bank NV	1,300%	28/02/2014	28/02/2019	EUR	5.523.000	5.523.000	-	0,742%	-	Banks	100,000	NL
Intermediate Capital Group PLC	4,282%	10/03/2014	10/03/2019	EUR	104.055.000	104.055.000	-	3,006%	BBB-	Commercial Finance	100,000	GB
Intervest Offices & Warehouses NV	3,430%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	34.494.250	34.494.250	-	2,461%	-	Real Estate	100,000	BE
Intesa Sanpaolo SpA	1,031%	17/04/2014	17/04/2019	EUR	1.381.870.000	1.381.870.000	94,70	0,925%	BBB-	Banks	99,756	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,487%	10/03/2014	10/03/2019	EUR	86.851.240	86.851.240	134,00	1,318%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,000%	10/07/2014	10/07/2019	EUR	7.288.260	7.288.260	-	1,887%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	0,320%	14/10/2014	14/10/2019	EUR	16.483.580	16.483.580	102,50	1,003%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,000%	03/07/2014	03/07/2019	EUR	17.329.840	17.329.840	158,42	1,562%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,000%	15/05/2014	15/05/2019	EUR	23.425.092	23.425.092	157,15	1,550%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,480%	10/02/2014	10/02/2019	EUR	57.964.008	57.964.008	155,83	1,536%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	0,636%	16/09/2014	16/09/2019	EUR	11.564.691	11.564.691	144,78	1,426%	-	Banks	100,000	IT
Intesa Sanpaolo SpA	1,120%	20/10/2014	20/10/2019	EUR	63.977.000	63.977.000	-	1,207%	BBB-	Banks	100,000	IT
Investitionsbank Berlin	1,000%	07/07/2014	25/06/2019	EUR	40.816.500	40.816.500	-	0,315%	-	Government Development Banks	101,892	DE
Investitionsbank Berlin	0,600%	07/10/2014	24/09/2019	EUR	63.260.500	63.260.500	-	0,315%	-	Government Development Banks	100,000	DE
Investitionsbank Berlin	0,600%	07/10/2014	24/09/2019	EUR	63.260.500	63.260.500	-	0,312%	-	Government Development Banks	100,000	DE
Investitionsbank Berlin	0,535%	19/08/2014	19/08/2019	EUR	53.271.200	53.271.200	-	0,461%	-	Government Development Banks	100,000	DE
Investitionsbank Berlin	1,000%	07/04/2014	19/03/2019	EUR	93.423.840	93.423.840	-	0,235%	-	Government Development Banks	100,332	DE
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1,050%	01/12/2014	01/12/2019	EUR	19.330.086.240	19.330.086.240	-	0,679%	-	Sovereigns	100,530	IT
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1,500%	01/07/2014	01/08/2019	EUR	21.930.677.802	21.930.677.802	-	0,600%	-	Sovereigns	100,740	IT
Jose de Mello Saude SA	3,925%	09/06/2014	09/06/2019	EUR	67.930.500	67.930.500	290,54	2,953%	-	Health Care Facilities & Services	100,000	PT

KBC Bank NV	1,000%	25/02/2014	25/02/2019	EUR	1.031.415.000	1.031.415.000	-	0,184%	-	Banks	99,391	BE
KBC Bank NV	0,132%	11/04/2014	11/04/2019	EUR	55.589.200	55.589.200	9,32	0,071%	-	Banks	100,000	BE
KBC IFIMA SA	0,633%	06/05/2014	06/05/2019	EUR	13.925.100	13.925.100	53,18	0,510%	-	Banks	100,000	LU
Kedrion SpA	4,625%	24/04/2014	24/04/2019	EUR	414.708.000	414.708.000	-	4,250%	-	Pharmaceuticals	100,000	IT
Kemira OYJ	2,500%	27/05/2014	27/05/2019	EUR	272.320.000	272.320.000	-	1,409%	-	Chemicals	99,629	FI
Kommunalbanken AS	0,875%	08/04/2014	08/04/2019	EUR	1.379.590.000	1.379.590.000	-	0,088%	AAA	Government Agencies	99,442	NO
Kreissparkasse Heilbronn	1,250%	20/03/2014	20/03/2019	EUR	20.665.200	20.665.200	-	0,280%	-	Banks	101,260	DE
KTG Agrar SE	7,250%	15/10/2014	15/10/2019	EUR	31.977.000	31.977.000	-	7,062%	-	Food & Beverage	100,000	DE
La Ville de Liege	2,000%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	8.778.445	8.778.445	-	0,357%	-	Government Regional	100,000	BE
Lagardere SCA	2,000%	19/09/2014	19/09/2019	EUR	641.655.000	641.655.000	-	1,927%	-	Publishing & Broadcasting	99,981	FR
Land Thuringen	0,250%	09/12/2014	09/12/2019	EUR	929.527.500	929.527.500	-	0,208%	-	Government Regional	99,684	DE
Landesbank Berlin AG	0,450%	17/09/2014	17/09/2019	EUR	84.183.450	84.183.450	-	0,222%	-	Banks	100,030	DE
Landesbank Berlin AG	0,970%	28/03/2014	28/03/2019	EUR	13.753.200	34.383.000	-	0,227%	-	Banks	99,950	DE
Landesbank Berlin AG	0,785%	27/05/2014	27/05/2019	EUR	13.616.000	27.232.000	-	0,215%	-	Banks	99,980	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,000%	25/02/2014	25/02/2019	EUR	1.375.220.000	1.375.220.000	-	0,050%	-	Banks	99,893	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,031%	23/04/2014	23/04/2019	EUR	138.191.000	138.191.000	4,54	0,023%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,400%	08/12/2014	08/11/2019	EUR	123.145.000	123.145.000	-	0,658%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,350%	17/09/2014	17/09/2019	EUR	129.513.000	129.513.000	53,52	0,513%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,500%	02/10/2014	02/09/2019	EUR	126.756.000	126.756.000	-	0,620%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,200%	26/02/2014	26/02/2019	EUR	136.715.000	136.715.000	-	0,556%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	1,200%	03/04/2014	03/04/2019	EUR	137.206.000	137.206.000	-	0,565%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,500%	24/07/2014	24/06/2019	EUR	134.697.000	134.697.000	-	0,583%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,350%	14/11/2014	14/10/2019	EUR	125.142.000	125.142.000	-	0,644%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,500%	19/08/2014	19/07/2019	EUR	133.178.000	133.178.000	-	0,595%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,500%	15/09/2014	15/08/2019	EUR	129.324.000	129.324.000	-	0,609%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,650%	09/09/2014	09/09/2019	EUR	12.915.900	12.915.900	-	0,623%	-	Banks	100,367	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,500%	27/10/2014	27/09/2019	EUR	127.045.000	127.045.000	-	0,634%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	0,350%	29/12/2014	29/11/2019	EUR	121.719.000	121.719.000	-	0,671%	-	Banks	100,000	DE
Landesbank Saar	1,000%	22/05/2014	22/05/2019	EUR	34.125.750	34.125.750	-	0,666%	-	Banks	100,150	DE
Landesbank Saar	1,000%	31/07/2014	31/07/2019	EUR	33.463.500	33.463.500	-	0,609%	-	Banks	100,670	DE
Landesbank Saar	0,625%	07/08/2014	31/07/2019	EUR	33.376.000	33.376.000	-	0,260%	-	Banks	99,850	DE

Landes-Hypothekenbank Steiermark AG	1,500%	08/01/2014	08/01/2019	EUR	67.852.000	67.852.000	-	1,471%	-	Banks	100,000	AT
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	0,250%	25/11/2014	25/11/2019	EUR	1.245.970.000	1.245.970.000	-	0,139%	AAA	Government Development Banks	99,708	DE
Landwirtschaftliche Rentenbank	0,500%	25/06/2014	25/06/2019	EUR	13.638.200	13.638.200	-	0,011%	AAA	Government Development Banks	100,000	DE
Lassila & Tikanoja OYJ	2,125%	15/09/2014	15/09/2019	EUR	38.797.200	38.797.200	-	0,827%	-	Waste & Environment Services & Equipment	99,653	FI
LBBW	0,212%	08/08/2014	08/08/2019	EUR	134.159.000	134.159.000	25,67	0,235%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,000%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	136.911.000	136.911.000	-	0,636%	-	Banks	101,070	DE
LBBW	1,000%	11/07/2014	11/07/2019	EUR	136.035.000	136.035.000	-	0,640%	-	Banks	101,170	DE
LBBW	0,530%	08/08/2014	08/08/2019	EUR	13.415.900	13.415.900	53,27	0,511%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	2,750%	08/04/2014	08/04/2019	EUR	137.959.000	137.959.000	-	0,620%	-	Banks	108,020	DE
LBBW	1,000%	24/02/2014	04/03/2019	EUR	13.736.500	13.736.500	-	0,160%	-	Banks	100,325	DE
LBBW	0,211%	11/02/2014	11/02/2019	EUR	136.489.000	136.489.000	26,89	0,247%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,100%	06/11/2014	06/11/2019	EUR	6.198.750	6.198.750	-	0,704%	-	Banks	105,000	DE
LBBW	0,625%	30/10/2014	30/10/2019	EUR	126.093.000	126.093.000	-	0,702%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,250%	09/04/2014	30/04/2019	EUR	138.093.000	138.093.000	-	0,623%	-	Banks	100,990	DE
LBBW	0,275%	19/12/2014	19/12/2019	EUR	12.240.300	12.240.300	-	0,160%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,900%	25/04/2014	25/04/2019	EUR	13.837.800	13.837.800	-	0,137%	-	Banks	99,960	DE
LBBW	1,250%	21/01/2014	21/01/2019	EUR	13.550.300	13.550.300	-	0,172%	-	Banks	100,420	DE
LBBW	1,125%	28/01/2014	28/01/2019	EUR	13.663.200	13.663.200	-	0,168%	-	Banks	100,200	DE
LBBW	1,000%	07/02/2014	07/02/2019	EUR	136.214.000	136.214.000	-	0,587%	-	Banks	99,610	DE
LBBW	0,950%	07/03/2014	07/03/2019	EUR	138.749.000	138.749.000	-	0,597%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	1,125%	11/03/2014	11/03/2019	EUR	138.644.000	138.644.000	-	0,600%	-	Banks	100,320	DE
LBBW	0,500%	20/06/2014	20/06/2019	EUR	6.792.100	6.792.100	-	0,122%	-	Banks	99,360	DE
LBBW	0,625%	27/06/2014	27/06/2019	EUR	13.641.100	13.641.100	-	0,117%	-	Banks	100,050	DE
LBBW	0,375%	13/10/2014	14/10/2019	EUR	12.665.900	12.665.900	-	0,136%	-	Banks	99,910	DE
LBBW	0,580%	14/10/2014	14/10/2019	EUR	63.301.000	63.301.000	-	0,693%	-	Banks	100,000	DE
LBBW	0,400%	28/10/2014	28/10/2019	EUR	12.738.900	12.738.900	-	0,141%	-	Banks	99,900	DE
LeasePlan Corp NV	0,836%	26/06/2014	26/06/2019	EUR	27.224.200	27.224.200	70,64	0,684%	-	Commercial Finance	100,000	NL
Lemminkainen OYJ	7,375%	26/06/2014	06/07/2019	EUR	136.121.000	136.121.000	-	6,423%	-	Industrial Other	100,000	FI
Lloyds Bank PLC	0,437%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	1.741.756.500	1.741.756.500	38,32	0,361%	A	Banks	99,850	GB

Lloyds Bank PLC	1,075%	04/06/2014	04/06/2019	EUR	6.804.150	6.804.150	-	0,643%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	0,581%	24/04/2014	24/04/2019	EUR	138.236.000	138.236.000	45,58	0,434%	-	Banks	100,000	GB
Lloyds Bank PLC	0,537%	29/05/2014	29/05/2019	EUR	13.609.000	13.609.000	46,74	0,445%	-	Banks	100,000	GB
Luxembourg Treasury Securities SA	0,436%	07/10/2014	07/10/2019	EUR	253.042.000	253.042.000	-	0,282%	AAA	Sovereigns	100,000	LU
Luximo Holding AG	6,250%	15/09/2014	15/09/2019	EUR	32.331.000	32.331.000	-	1,344%	-	Financial Services	100,000	CH
Mahle GmbH	1,600%	05/12/2014	05/12/2019	EUR	35.648.540	35.648.540	-	1,470%	-	Auto Parts Manufacturing	100,000	DE
Mantovabanca 1896 Credito Cooperativo SC	3,000%	02/01/2014	02/01/2019	EUR	1.777.711	13.674.700	-	2,519%	-	Banks	100,000	IT
Mediobanca SpA	2,250%	18/03/2014	18/03/2019	EUR	1.044.142.500	1.044.142.500	-	1,319%	BBB-	Banks	99,888	IT
Mediobanca SpA	1,125%	17/06/2014	17/06/2019	EUR	1.015.845.000	1.015.845.000	-	0,257%	A	Banks	99,566	IT
Metsa Board OYJ	4,000%	13/03/2014	13/03/2019	EUR	311.793.750	311.793.750	-	1,963%	BB	Forest & Paper Products Manufacturing	99,203	FI
mFinance France SA	2,375%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	689.885.000	689.885.000	-	2,082%	BBB	Banks	99,484	FR
MM Warburg & Co Hypothekenbank AG	0,281%	24/04/2014	24/04/2019	EUR	27.647.200	27.647.200	10,39	0,082%	-	Consumer Finance	100,000	DE
MM Warburg & Co Hypothekenbank AG	0,225%	04/11/2014	04/11/2019	EUR	31.363.000	31.363.000	17,47	0,153%	-	Consumer Finance	100,000	DE
MM Warburg & Co Hypothekenbank AG	0,700%	20/08/2014	20/08/2019	EUR	26.580.400	26.580.400	-	0,257%	-	Consumer Finance	100,000	DE
MM Warburg & Co Hypothekenbank AG	0,271%	14/08/2014	14/08/2019	EUR	26.737.400	26.737.400	6,94	0,047%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Mota-Engil SGPS SA	5,500%	22/04/2014	22/04/2019	EUR	151.800.000	151.800.000	-	4,604%	-	Industrial Other	100,000	PT
Muenchener Hypothekenbank eG	0,375%	24/09/2014	24/09/2019	EUR	383.595.000	383.595.000	-	0,124%	-	Consumer Finance	99,886	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	0,132%	09/07/2014	09/07/2019	EUR	20.167.368	20.167.368	19,11	0,169%	-	Consumer Finance	100,000	DE
Muenchener Hypothekenbank eG	2,400%	11/11/2014	11/11/2019	EUR	6.231.800	6.231.800	-	0,419%	-	Consumer Finance	110,060	DE
Municipality of Eindhoven Netherlands	1,255%	23/04/2014	23/04/2019	EUR	20.728.650	20.728.650	-	0,044%	-	Government Regional	100,000	NL
Nationwide Building Society	0,750%	25/06/2014	25/06/2019	EUR	1.363.820.000	1.363.820.000	-	0,270%	AAA	Banks	99,829	GB
Nationwide Building Society	1,625%	03/04/2014	03/04/2019	EUR	1.029.045.000	1.029.045.000	-	0,644%	A	Banks	99,886	GB
Nationwide Building Society	0,491%	22/10/2014	22/10/2019	EUR	63.319.500	63.319.500	56,06	0,539%	A	Banks	100,000	GB
Natixis Pfandbriefbank AG	0,162%	26/06/2014	03/06/2019	EUR	72.144.130	72.144.130	8,83	0,066%	-	Consumer Finance	99,717	DE
Natixis Pfandbriefbank AG	1,000%	12/06/2014	03/06/2019	EUR	13.546.700	13.546.700	-	0,271%	-	Consumer Finance	100,580	DE
NBG Finance PLC	4,375%	30/04/2014	30/04/2019	EUR	1.039.935.000	1.039.935.000	-	29,188%	-	Financial Services	99,451	GB
Nederlandse Waterschapsbank NV	0,625%	03/07/2014	03/07/2019	EUR	680.135.000	680.135.000	-	0,105%	AA+	Government Agencies	99,428	NL
Nederlandse Waterschapsbank NV	1,125%	27/01/2014	28/01/2019	EUR	1.367.850.000	1.367.850.000	-	0,060%	AA+	Government Agencies	99,436	NL
Neue ZWL Zahnradwerk Leipzig GmbH	7,500%	04/03/2014	04/03/2019	EUR	34.333.500	34.333.500	-	4,975%	-	Machinery Manufacturing	100,000	DE
NIBC Bank NV	1,250%	08/04/2014	08/04/2019	EUR	689.795.000	689.795.000	-	0,200%	AAA	Financial Services	99,659	NL

Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,125%	19/02/2014	19/02/2019	EUR	687.610.000	687.610.000	-	0,304%	-	Banks	99,412	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,750%	10/09/2014	10/09/2019	EUR	129.019.000	129.019.000	-	0,787%	-	Banks	100,430	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,310%	19/11/2014	19/11/2019	EUR	125.502.000	125.502.000	-	0,321%	-	Banks	99,930	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,125%	12/05/2014	08/05/2019	EUR	137.571.000	137.571.000	-	0,729%	-	Banks	100,350	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	1,000%	15/09/2014	16/09/2019	EUR	258.648.000	258.648.000	-	0,789%	-	Banks	101,190	DE
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	0,900%	08/08/2014	08/08/2019	EUR	268.318.000	268.318.000	-	0,767%	-	Banks	99,860	DE
Nordea Bank AB	0,489%	20/05/2014	20/05/2019	EUR	41.067.900	41.067.900	32,51	0,303%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank AB	0,499%	20/05/2014	20/05/2019	EUR	34.223.250	34.223.250	32,64	0,304%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank AB	0,288%	26/11/2014	26/11/2019	EUR	12.504.600	12.504.600	31,75	0,295%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank AB	0,451%	12/08/2014	12/08/2019	EUR	33.399.250	33.399.250	30,27	0,281%	-	Diversified Banks	100,000	SE
Nordea Bank Finland Abp	1,250%	14/01/2014	14/01/2019	EUR	2.052.465.000	2.052.465.000	-	0,134%	-	Banks	99,769	FI
Pohjola Bank Oyj	1,125%	17/06/2014	17/06/2019	EUR	1.015.845.000	1.015.845.000	-	0,551%	AA-	Banks	99,720	FI
Porr Ag	3,875%	28/10/2014	28/10/2019	EUR	66.257.567	71.671.599	-	2,324%	-	Industrial Other	100,000	AT
Poste Vita SpA	2,875%	30/05/2014	30/05/2019	EUR	1.023.090.000	1.023.090.000	-	1,883%	-	Life Insurance	99,597	IT
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA Via PKO Finance AB	2,324%	23/01/2014	23/01/2019	EUR	683.755.000	683.755.000	-	1,449%	BBB+	Banks	100,000	SE
Propertize BV	1,000%	18/02/2014	18/02/2019	EUR	825.234.000	825.234.000	-	0,110%	-	Real Estate	99,637	NL
Raiffeisen Bank International AG	1,370%	18/09/2014	18/09/2019	EUR	16.799.900	16.799.900	-	1,629%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	1,081%	20/01/2014	21/01/2019	EUR	135.600.000	135.600.000	109,15	1,069%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	1,370%	12/09/2014	12/09/2019	EUR	12.973.500	12.973.500	-	1,584%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	0,993%	06/11/2014	06/11/2019	EUR	49.590.000	49.590.000	111,02	1,088%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	1,660%	22/04/2014	22/04/2019	EUR	13.800.000	13.800.000	-	1,582%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen Bank International AG	0,490%	19/05/2014	19/05/2019	EUR	274.190.000	274.190.000	23,97	0,218%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,236%	18/12/2014	18/12/2019	EUR	60.190.620	60.190.620	150,33	1,481%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,840%	20/01/2014	20/01/2019	EUR	66.444.000	66.444.000	-	1,278%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	0,781%	20/01/2014	21/01/2019	EUR	66.444.000	66.444.000	141,50	1,393%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,625%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	66.175.970	66.175.970	-	1,279%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,125%	28/10/2014	28/10/2019	EUR	62.420.610	62.420.610	-	1,399%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Burgenland und Revisionsverband	1,500%	02/06/2014	02/06/2019	EUR	66.617.460	66.617.460	-	1,321%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,420%	11/02/2014	11/02/2019	EUR	13.648.900	13.648.900	-	2,185%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,250%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	17.824.443	17.824.443	-	2,173%	-	Banks	100,000	AT

Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	1,500%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	19.346.342	19.346.342	-	2,179%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG	0,501%	25/07/2014	25/07/2019	EUR	40.286.400	40.286.400	160,88	1,587%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG	1,400%	08/05/2014	08/05/2019	EUR	102.572.880	102.572.880	-	1,235%	-	Banks	100,200	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	1,000%	26/09/2014	26/09/2019	EUR	38.067.900	38.067.900	161,05	1,588%	-	Banks	100,950	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	0,390%	03/12/2014	03/12/2019	EUR	6.152.300	6.152.300	-	0,290%	-	Banks	100,000	AT
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren-und Revisionsverband registrierte GenmbH	1,250%	13/01/2014	13/01/2019	EUR	40.962.300	40.962.300	-	1,264%	-	Banks	100,450	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,400%	10/02/2014	10/02/2019	EUR	40.925.400	40.925.400	-	1,301%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,250%	15/04/2014	15/04/2019	EUR	41.457.600	41.457.600	-	1,321%	-	Banks	100,800	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,250%	26/05/2014	26/05/2019	EUR	40.936.200	40.936.200	-	1,335%	-	Banks	100,750	AT
Raiffeisenverband Salzburg	1,000%	10/07/2014	10/07/2019	EUR	40.792.500	40.792.500	-	1,350%	-	Banks	100,750	AT
Raiffeisenverband Salzburg	0,750%	15/09/2014	15/09/2019	EUR	38.797.200	38.797.200	-	1,386%	-	Banks	100,500	AT
Raiffeisenverband Salzburg	0,700%	29/12/2014	29/12/2019	EUR	36.515.700	36.515.700	-	1,449%	-	Banks	100,750	AT
RCI Banque SA	1,125%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	757.722.000	757.722.000	-	0,817%	BBB	Automobiles Manufacturing	99,836	FR
Region of Rhone-Alpes France	1,312%	17/04/2014	17/04/2019	EUR	13.818.700	13.818.700	-	0,156%	-	Government Regional	100,000	FR
Rigoni DI Asiago Srl	6,250%	18/07/2014	18/07/2019	EUR	9.463.090	9.463.090	-	7,933%	-	Retail - Consumer Staples	100,000	IT
Romagna Est Banca di Credito Cooperativo Societa Cooperativa	1,500%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	1.380	1.380	307,33	3,121%	-	Banks	100,000	IT
Romagna Est Banca di Credito Cooperativo Societa Cooperativa	2,000%	15/01/2014	15/01/2019	EUR	353.441	353.441	330,49	3,353%	-	Banks	100,000	IT
Romagna Est Banca di Credito Cooperativo Societa Cooperativa	1,500%	01/08/2014	01/08/2019	EUR	73.871	73.871	314,50	3,193%	-	Banks	100,000	IT
Royal Bank of Scotland Group PLC	1,625%	25/06/2014	25/06/2019	EUR	1.363.820.000	1.363.820.000	-	1,363%	BBB-	Diversified Banks	99,871	GB
S IMMO AG	3,000%	03/10/2014	03/10/2019	EUR	125.128.000	125.128.000	-	2,017%	-	Real Estate	101,431	AT
Santander International Products PLC	1,730%	08/05/2014	08/05/2019	EUR	13.861.200	13.861.200	-	0,863%	-	Banks	100,000	IE
Saras SpA	5,000%	17/07/2014	17/07/2019	EUR	236.675.250	236.675.250	-	3,173%	-	Refining & Marketing	100,000	IT
SBAB Bank AB	0,551%	17/01/2014	17/01/2019	EUR	27.063.600	27.063.600	52,32	0,501%	A	Consumer Finance	100,000	SE
Semapa-Sociedade de Investimento e Gestao	3,322%	17/04/2014	17/04/2019	EUR	207.280.500	207.280.500	262,17	2,670%	-	Forest & Paper Products Manufacturing	100,000	PT
SG Issuer SA	4,000%	20/01/2014	10/01/2019	EUR	20.340.000	20.340.000	-	3,116%	-	Financial Services	100,000	LU
SG Issuer SA	5,000%	12/06/2014	10/07/2019	EUR	9.753.624	13.546.700	-	4,509%	-	Financial Services	100,000	LU
Sipcam S.p.A.	6,500%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	18.943.050	18.943.050	-	4,928%	-	Chemicals	100,000	IT

Skandinaviska Enskilda Banken AB	0,434%	01/04/2014	01/04/2019	EUR	275.954.000	275.954.000	35,13	0,329%	A+	Banks	100,000	SE
Snam SpA	1,500%	24/04/2014	24/04/2019	EUR	691.180.000	691.180.000	-	0,673%	BBB	Utilities	99,352	IT
Societe Centrale des Bois et Scieries de la Manche SA	5,250%	21/07/2014	21/07/2019	EUR	37.857.680	37.857.680	-	0,909%	-	Real Estate	100,000	FR
Societe Publique de Gestion de l'Eau SA	1,524%	21/05/2014	21/05/2019	EUR	34.157.000	34.157.000	-	0,662%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	BE
Societe Publique de Gestion de l'Eau SA	1,466%	15/05/2014	15/05/2019	EUR	8.909.485	8.909.485	-	0,677%	-	Waste & Environment Services & Equipment	100,000	BE
Societe Wallonne des Eaux Scrl	1,750%	15/07/2014	15/07/2019	EUR	6.783.800	6.783.800	-	0,647%	-	Utilities	100,000	BE
Sonae Capital SGPS SA	4,052%	28/05/2014	28/05/2019	EUR	57.765.150	57.765.150	372,29	3,771%	-	Home Improvement	100,000	PT
SpareBank 1 SMN	1,500%	20/05/2014	20/05/2019	EUR	684.465.000	684.465.000	-	0,737%	-	Banks	99,780	NO
Sparebanken Vest	0,621%	17/01/2014	17/01/2019	EUR	14.884.980	14.884.980	46,98	0,448%	-	Banks	100,000	NO
Sparebanken Vest	0,328%	27/11/2014	27/11/2019	EUR	62.358.500	62.358.500	46,90	0,447%	-	Banks	100,000	NO
Sparebanken Vest Boligkreditt AS	1,250%	16/01/2014	16/01/2019	EUR	679.665.000	679.665.000	-	0,187%	-	Consumer Finance	99,410	NO
Stadtsparkasse Moenchengladbach	1,100%	01/03/2014	01/03/2019	EUR	6.868.100	6.868.100	-	0,878%	-	Banks	100,000	DE
State of Berlin	0,375%	27/10/2014	28/10/2019	EUR	12.704.500	12.704.500	-	0,203%	-	Government Local	99,995	DE
State of Berlin	0,600%	07/10/2014	24/09/2019	EUR	44.282.350	44.282.350	-	0,306%	-	Government Local	100,000	DE
State of Brandenburg	0,875%	30/04/2014	30/04/2019	EUR	831.948.000	831.948.000	-	0,138%	-	Government Regional	99,917	DE
State of Carinthia	0,902%	12/09/2014	12/09/2019	EUR	36.066.330	36.066.330	80,46	0,853%	-	Government Regional	100,000	AT
State of Lower Saxony	0,400%	04/11/2014	04/11/2019	EUR	62.726.000	62.726.000	-	0,219%	-	Government Regional	99,900	DE
State of North Rhine-Westphalia	1,000%	11/02/2014	15/02/2019	EUR	853.056.250	853.056.250	-	0,102%	AA-	Government Regional	99,878	DE
State of Saxony-Anhalt	0,031%	15/05/2014	15/05/2019	EUR	27.413.800	27.413.800	6,51	0,043%	-	Government Regional	99,890	DE
State of Schleswig-Holstein Germany	0,600%	07/10/2014	24/09/2019	EUR	50.608.400	50.608.400	-	0,380%	-	Government Regional	101,120	DE
State of Schleswig-Holstein Germany	0,600%	07/10/2014	24/09/2019	EUR	50.608.400	50.608.400	-	0,381%	-	Government Regional	101,120	DE
Steiermaerkische Bank und Sparkassen AG	1,125%	10/03/2014	10/03/2019	EUR	97.118.000	97.118.000	-	1,279%	-	Banks	100,000	AT
Steiermaerkische Bank und Sparkassen AG	1,000%	07/11/2014	07/11/2019	EUR	60.920.720	60.920.720	-	1,464%	-	Banks	100,000	AT
Suedwestbank AG	1,250%	30/01/2014	30/01/2019	EUR	13.552.300	13.552.300	-	0,818%	-	Banks	99,850	DE
Suominen OYJ	4,375%	23/09/2014	23/09/2019	EUR	96.354.750	96.354.750	-	3,668%	-	Medical Equipment & Devices Manufacturing	99,730	FI
Svensk Exportkredit AB	0,041%	12/08/2014	12/08/2019	EUR	40.079.100	40.079.100	12,47	0,103%	AA+	Government Agencies	100,000	SE
Svenska Handelsbanken AB	0,481%	24/01/2014	24/01/2019	EUR	205.245.000	205.245.000	25,24	0,230%	-	Banks	100,000	SE
Swedbank AB	1,500%	18/03/2014	18/03/2019	EUR	1.044.142.500	1.044.142.500	-	0,550%	A+	Banks	99,776	SE
Symrise AG	1,750%	10/07/2014	10/07/2019	EUR	679.875.000	679.875.000	-	0,989%	-	Chemicals	99,314	DE

Taalertehdas Oyj	5,500%	19/09/2014	19/09/2019	EUR	25.666.200	25.666.200	-	1,216%	-	Financial Services	100,000	FI
TeliaSonera AB	1,375%	18/02/2014	18/02/2019	EUR	687.695.000	687.695.000	-	0,389%	A-	Wireless Telecommunications Services	99,483	SE
TerniEnergia SpA	6,875%	06/02/2014	06/02/2019	EUR	34.003.000	34.003.000	-	9,297%	-	Renewable Energy	100,000	IT
Tesco Corporate Treasury Services PLC	1,375%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	1.711.387.500	1.711.387.500	-	2,046%	BB+	Supermarkets & Pharmacies	99,684	GB
Titan Global Finance PLC	4,250%	10/07/2014	10/07/2019	EUR	404.525.625	407.925.000	-	5,998%	BB	Construction Materials Manufacturing	100,000	GB
Trevi Finanziaria Industriale SpA	5,250%	28/07/2014	28/07/2019	EUR	67.207.000	67.207.000	-	5,033%	-	Oil & Gas Services & Equipment	100,000	IT
UBM Development AG	4,875%	09/07/2014	09/07/2019	EUR	272.532.000	272.532.000	-	3,914%	-	Real Estate	100,000	AT
Unibail-Rodamco SE	0,691%	14/02/2014	14/02/2019	EUR	41.085.900	41.085.900	44,89	0,427%	A	Real Estate	100,000	FR
UniCredit Bank AG	2,300%	26/03/2014	18/04/2019	EUR	206.830.500	206.830.500	-	2,227%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,000%	24/06/2014	19/07/2019	EUR	2.717.320	27.173.200	-	2,574%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	3,100%	23/09/2014	18/10/2019	EUR	3.211.825	3.211.825	-	2,583%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	3,400%	18/03/2014	18/04/2019	EUR	27.843.800	27.843.800	-	2,115%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	3,500%	17/06/2014	19/07/2019	EUR	13.544.600	13.544.600	-	2,162%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	2,500%	23/04/2014	23/04/2019	EUR	69.095.500	69.095.500	-	1,996%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	2,350%	28/01/2014	18/01/2019	EUR	2.732.640	27.326.400	-	1,544%	-	Banks	100,000	DE
UniCredit Bank AG	3,250%	24/06/2014	19/07/2019	EUR	5.434.640	27.173.200	-	2,165%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	2,100%	01/07/2014	19/07/2019	EUR	3.422.775	27.382.200	-	1,650%	-	Banks	101,000	DE
UniCredit Bank AG	1,140%	17/06/2014	17/06/2019	EUR	16.253.520	16.253.520	-	0,791%	-	Banks	99,980	DE
UniCredit Bank Austria AG	1,500%	12/02/2014	12/02/2019	EUR	33.473.194	33.473.194	-	1,564%	-	Banks	101,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,500%	08/07/2014	08/07/2019	EUR	41.908.636	41.908.636	153,64	1,514%	BBB	Banks	101,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,092%	11/07/2014	11/07/2019	EUR	40.810.500	40.810.500	137,62	1,354%	BBB	Banks	100,000	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,250%	16/07/2014	16/07/2019	EUR	16.910.375	16.910.375	155,46	1,533%	-	Banks	100,500	AT
UniCredit Bank Austria AG	1,500%	28/05/2014	29/04/2019	EUR	26.504.010	26.504.010	-	1,555%	-	Banks	101,000	AT
UniCredit Bank Ireland PLC	2,100%	11/02/2014	11/02/2019	EUR	189.037.265	189.037.265	-	0,907%	BBB-	Financial Services	101,000	IE
UniCredit SpA	1,500%	19/06/2014	19/06/2019	EUR	1.362.080.000	1.362.080.000	-	1,065%	BBB-	Banks	99,504	IT
UniCredit SpA	1,100%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	173.846.684	173.846.684	128,37	1,262%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	2,875%	18/02/2014	18/02/2019	EUR	1.375.390.000	1.375.390.000	-	1,255%	BBB-	Banks	99,876	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	0,786%	05/03/2014	05/03/2019	EUR	274.700.000	274.700.000	6,69	0,045%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,500%	30/06/2014	30/06/2019	EUR	415.201.082	415.201.082	-	1,459%	-	Banks	100,000	IT

Unione di Banche Italiane SCpA	1,500%	30/04/2014	30/04/2019	EUR	280.023.991	280.023.991	-	1,450%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	0,736%	05/03/2014	05/03/2019	EUR	961.450.000	961.450.000	5,21	0,030%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,200%	31/07/2014	31/07/2019	EUR	275.757.980	275.757.980	-	1,480%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,000%	30/09/2014	30/09/2019	EUR	176.801.800	176.801.800	-	1,509%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	0,700%	31/12/2014	31/12/2019	EUR	164.761.767	164.761.767	-	1,564%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,750%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	127.643.992	127.643.992	-	1,531%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	0,700%	31/10/2014	31/10/2019	EUR	236.762.006	236.762.006	-	1,528%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,750%	28/02/2014	28/02/2019	EUR	315.477.902	315.477.902	-	1,409%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,000%	05/09/2014	05/09/2019	EUR	279.621.154	279.621.154	-	1,501%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,500%	31/03/2014	31/03/2019	EUR	241.015.250	241.015.250	-	1,458%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	2,000%	30/06/2014	30/06/2019	EUR	81.523.594	81.523.594	-	1,485%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	0,700%	28/11/2014	28/11/2019	EUR	139.410.518	139.410.518	-	1,545%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	1,500%	30/05/2014	30/05/2019	EUR	244.217.039	244.217.039	-	1,466%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	2,150%	30/05/2014	30/05/2019	EUR	5.935.286	5.935.286	-	1,494%	-	Banks	100,000	IT
Unione di Banche Italiane SCpA	2,000%	31/01/2014	31/01/2019	EUR	3.720.710	3.720.710	149,16	1,540%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	3,000%	11/03/2014	11/03/2019	EUR	568.440	568.440	-	3,222%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	2,500%	22/09/2014	22/09/2019	EUR	590.281	590.281	-	3,418%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	2,750%	01/07/2014	01/07/2019	EUR	451.806	451.806	-	3,338%	-	Banks	100,000	IT
Unipol Banca SpA	2,150%	15/12/2014	15/12/2019	EUR	1.355.698	1.355.698	-	3,493%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SCPA	4,000%	20/05/2014	20/05/2019	EUR	684.465.000	684.465.000	-	3,509%	B+	Banks	99,556	IT
Veneto Banca SpA	3,500%	25/03/2014	25/03/2019	EUR	37.996.046	37.996.046	334,56	3,394%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	3,400%	22/04/2014	22/04/2019	EUR	15.042.000	15.042.000	-	3,352%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	3,750%	16/05/2014	16/05/2019	EUR	21.238.100	21.238.100	-	3,368%	-	Banks	100,000	IT
Veneto Banca SpA	3,250%	22/08/2014	22/08/2019	EUR	10.591.680	10.591.680	-	3,445%	-	Banks	100,000	IT
Ville de Namur	1,702%	05/05/2014	05/05/2019	EUR	6.938.200	6.938.200	-	0,392%	-	Government Regional	100,000	BE
Volksbank eG Nienburg/Weser	1,250%	15/05/2014	15/05/2019	EUR	6.853.450	6.853.450	-	0,821%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Euskirchen	2,000%	30/05/2014	30/05/2019	EUR	6.820.600	6.820.600	-	0,802%	-	Banks	104,840	DE
Volksbank Regensburg eG	1,000%	15/05/2014	15/05/2019	EUR	20.560.350	20.560.350	-	0,646%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Rhein-Wehra	0,100%	15/10/2014	15/10/2019	EUR	6.395.400	6.395.400	-	0,837%	-	Banks	100,000	DE
Volksbank Salzburg eG	1,250%	03/03/2014	04/03/2019	EUR	6.868.100	6.868.100	150,07	1,670%	-	Banks	100,000	AT
Volksbank Weingarten	1,070%	06/05/2014	06/05/2019	EUR	9.747.570	9.747.570	-	0,720%	-	Banks	100,000	DE

Volksbank Weingarten	1,070%	02/05/2014	02/05/2019	EUR	6.931.900	6.931.900	-	0,723%	-	Banks	100,000	DE
Volkskreditbank AG	1,250%	17/03/2014	17/03/2019	EUR	13.860.845	13.924.900	-	1,337%	-	Banks	100,000	AT
Volkswagen Bank GmbH	1,500%	13/02/2014	13/02/2019	EUR	1.025.227.500	1.025.227.500	-	0,447%	A	Automobiles Manufacturing	99,537	DE
Vontobel Financial Products GmbH	3,250%	04/04/2014	04/04/2019	EUR	34.263.250	34.263.250	-	2,728%	-	Banks	100,000	DE
Vontobel Financial Products GmbH	1,350%	27/06/2014	27/06/2019	EUR	34.102.750	34.102.750	126,92	1,247%	-	Banks	100,000	DE
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	1,500%	22/05/2014	22/05/2019	EUR	682.515.000	682.515.000	-	1,730%	-	Banks	99,614	AT
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	0,519%	17/01/2014	17/01/2019	EUR	27.063.600	27.063.600	173,60	1,784%	-	Banks	100,000	AT
WEB Windenergie AG	3,500%	07/10/2014	07/10/2019	EUR	13.411.226	13.411.226	-	1,690%	-	Renewable Energy	100,000	AT
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,400%	09/12/2014	09/12/2019	EUR	61.968.500	61.968.500	-	0,567%	-	Banks	99,900	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	2,000%	17/01/2014	20/12/2018	EUR	33.829.500	33.829.500	-	0,536%	-	Banks	104,050	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,785%	21/05/2014	21/05/2019	EUR	34.157.000	34.157.000	-	0,524%	-	Banks	100,000	DE
WGZ-Bank AG Westdeutsche Genossenschafts-Zentralbank	0,500%	01/09/2014	16/09/2019	EUR	65.654.000	65.654.000	-	0,539%	-	Banks	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,250%	04/12/2014	20/11/2019	EUR	618.730.000	618.730.000	-	0,104%	AAA	Consumer Finance	99,926	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1,125%	25/03/2014	25/03/2019	EUR	345.670.000	345.670.000	-	0,315%	AA-	Consumer Finance	100,200	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	0,081%	15/01/2014	15/01/2019	EUR	67.969.500	67.969.500	7,32	0,051%	AAA	Consumer Finance	100,000	DE
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	2,450%	11/12/2014	11/12/2019	EUR	6.193.400	6.193.400	-	0,925%	AA-	Consumer Finance	110,000	DE
WSP Aurum GMBH	2,750%	31/05/2014	31/05/2019	EUR	1.359.540.000	1.359.540.000	-	1,126%	-	Financial Services	100,000	DE
Wuestenrot Bank AG Pfandbriefbank	1,250%	22/05/2014	22/05/2019	EUR	68.251.500	68.251.500	-	1,074%	-	Consumer Finance	99,830	DE
Wuestenrot Bank AG Pfandbriefbank	1,450%	20/03/2014	20/03/2019	EUR	27.553.600	27.553.600	-	1,083%	-	Consumer Finance	99,830	DE
Yorkshire Building Society	2,125%	18/03/2014	18/03/2019	EUR	835.314.000	835.314.000	-	1,004%	-	Financial Services	99,991	GB
Zurich Insurance Co Ltd	0,848%	04/12/2014	04/12/2019	EUR	569.231.600	569.231.600	-	0,838%	-	Life Insurance	100,000	CH

ANEXO III. Rendimientos obtenidos por los intereses producidos por los saldos medios de las cuentas operativas de la CAC en el periodo 2011-2014

BANCO PASTOR

IBAN ES047 0072 0801 4200 00108288

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010+0,50%	1,513%		113.749,89	114.955,10	1.205,21
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011+0,50%	1,731%		36.990,50	34.941,89	-2.048,60*
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011+0,75%	2,287%		15.683,88	15.476,20	-207,68
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011+0,75%	2,300%		69.943,05	70.098,94	155,89
		TOTAL INTERESES AÑO		236.367,32	235.472,13	-895,19

* En este periodo se regularizan periodos anteriores por lo que se produce esta diferencia,

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Acuerdo hasta 31,03,2012	2,110%		148.287,38	148.290,53	3,15
2º Trimestre	Acuerdo hasta 30,06,2012 Euribor 3m(28,03,2012) 0,787% + 0,75%	1,537%		69.722,02	70.042,98	320,96
3º Trimestre	Acuerdo hasta 30,09,2012 Euribor 3m(27,06,2012) 0,652% + 0,75%	1,402%		33.626,60	33.627,89	1,29
4º Trimestre	Acuerdo hasta 31,12,2012 Euribor 3m(227,09,2012) 0,221% + 0,75%	0,971%		44.180,67	44.229,49	48,82
		TOTAL INTERESES AÑO		295.816,67	296.190,89	374,22

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012+ 75 p.b.	0,935%		34.056,44	34.247,58	191,14
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013+75 p.b.	0,962%		36.959,19	36.870,66	-88,53
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013+75 p.b.	0,969%		30.495,44	30.494,05	-1,39
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013+75 p.b.	0,974%		23.509,85	24.950,38	1.440,53
		TOTAL INTERESES AÑO		125.020,91	126.562,67	1.541,76

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

BANCO POPULAR
ES74-0075-0012-18-0660003643

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%	0,75%	38.763,36	38.763,36	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		38.763,36	38.763,36	0,00

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%	+0,75 p.b.	123.403,38	123.322,61	-80,77
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%	+0,75 p.b.	75.157,95	75.157,95	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%	+0,75 p.b.	34.771,67	34.814,63	42,96
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%	+0,75 p.b.	128.913,26	128.452,82	-460,44
		TOTAL INTERESES AÑO		362.246,25	361.748,01	-498,24

B SBADELL

ES53 0081 028491 0001528356

2011		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,763%		209.380,48	211.927,30	2.546,82
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,981%		67.278,47	68.178,46	899,99
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	2,287%		71.777,36	73.187,94	1.410,58
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	2,300%		116.164,63	117.778,03	1.613,40
		TOTAL INTERESES AÑO		464.600,94	471.071,73	6.470,79
2012		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2012	2,400%		210.116,75	213.618,69	3.501,94
2º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2012	2,400%		111.767,16	113.629,94	1.862,78
3º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2012	2,400%		87.749,14	89.211,62	1.462,48
4º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2012	2,400%		140.932,89	143281,77	2.348,88
		TOTAL INTERESES AÑO		550.565,93	559.742,02	9.176,09
2013		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2013	2,500%		206.561,15	209.430,05	2.868,90
2º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2013	2,500%		346.652,29	351.466,91	4.814,62
3º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2013	2,500%		1.212.498,18	1.229.338,44	16.840,26
4º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2013	2,5% / 1,25%		607.079,73	618.987,92	11.908,19
		TOTAL INTERESES AÑO		2.372.791,35	2.409.223,32	36.431,97
2014		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2014	0,981%		117.422,95	119.641,43	2.218,48
2º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2014	0,981%		35.750,51	36.247,04	496,53
3º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2014	0,981%		19.823,62	20.098,95	275,33
4º Trimestre	Acuerdo hasta 31.12.2014	0,981%		157.371,11	135.539,67	-21.831,44
		TOTAL INTERESES AÑO		330.368,19	311.527,09	-18.841,10

BSCH

ES37 0049 1848 77 2810195493

2011		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%		34.298,89	34.713,22	414,33
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%		23.534,36	23.861,23	326,87
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%		14.990,91	15.145,15	154,24
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%		34.266,71	34.742,25	475,54
		TOTAL INTERESES AÑO		107.090,87	108.461,85	1.370,98
2012		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		30.987,80	31.923,02	935,22
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		60.099,69	61.373,98	1.274,29
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		20.869,00	21.279,19	410,19
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		12.529,10	12893,48	364,38
		TOTAL INTERESES AÑO		124.485,60	127.469,67	2.984,07
2013		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		10.223,75	10.365,75	142,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		14.453,01	14.715,40	262,39
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		13.569,71	13.758,18	188,47
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		15.170,88	15.381,35	210,47
		TOTAL INTERESES AÑO		53.417,35	54.220,68	803,33
2014		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		20.868,58	21.101,14	232,56
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		12.445,35	12.618,28	172,93
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		7.282,18	7.383,32	101,14
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		3.655,26	3.749,00	93,74
		TOTAL INTERESES AÑO		44.251,38	44.851,74	600,36

BSCH						
0049 1848 70 2410196023						
2011		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%		14.226,55	14.141,64	-84,91
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%		21.680,14	21.680,14	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%		18.847,07	18.824,56	-22,51
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%		27.137,95	27.137,36	-0,59
		TOTAL INTERESES AÑO		81.891,72	81.783,70	-108,02
2012		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		21.934,49	21.938,15	3,66
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		14.234,43	14.332,20	97,77
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		6.512,61	6.515,26	2,65
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		5.200,06	5207,16	7,10
		TOTAL INTERESES AÑO		47.881,59	47.992,77	111,18
2013		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		3.056,00	3.056,00	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		1.889,27	1.897,84	8,57
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		1.042,71	1.042,63	-0,08
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		3.195,37	3.195,37	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		9.183,35	9.191,84	8,49
2014		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		2.999,42	2.998,15	-1,27
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		5.029,66	5.029,41	-0,25
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		1.659,42	1.660,13	0,71
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		369,64	455,93	86,29
		TOTAL INTERESES AÑO		10.058,14	10.143,62	85,48

BSCH						
0049 1848 71 2310341015						
2011		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%		4.425,33	4.425,33	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%		20.605,00	20.561,68	-43,32
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%		1.056,80	1.054,51	-2,29
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%		953,93	953,83	-0,10
		TOTAL INTERESES AÑO		27.041,05	26.995,35	-45,70
2012		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		4.661,14	4.661,16	0,02
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		488,40	492,37	3,97
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		409,06	409,99	0,93
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		138,65	141,6	2,95
		TOTAL INTERESES AÑO		5.697,26	5.705,12	7,86
2013		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		671,17	671,17	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		95,34	95,40	0,06
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		0,00		
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		0,00		
		TOTAL INTERESES AÑO		766,50	766,57	0,07
2014		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		828,46	828,46	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		191,52	191,40	-0,12
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		20,17	20,17	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		0,07	0,16	0,09
		TOTAL INTERESES AÑO		1.040,22	1.040,19	-0,03

BSCH						
ES29 0049 1848 78 2710344855						
2011		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				
2012		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		0,00		0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		329,00	329,00	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		43.329,81	43.386,25	56,44
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		22.621,01	23975,11	1.354,10
		TOTAL INTERESES AÑO		66.279,82	67.690,36	1.410,54
2013		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		29.452,17	29.452,17	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		12.712,57	12.693,10	-19,47
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		14.037,20	14.037,19	-0,01
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		21.985,03	21.979,40	-5,63
		TOTAL INTERESES AÑO		78.186,97	78.161,86	-25,11
2014		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		36.735,68	36.516,21	-219,47
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		10.582,02	10.581,75	-0,27
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		9.254,29	9.254,94	0,65
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		6.916,17	6.920,14	3,97
		TOTAL INTERESES AÑO		63.488,16	63.273,04	-215,12

BANCA MARCH

ES93 0061 0155 74 0084660115

2011					Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%	+0,80%	1,813%	241.798,53	242.560,59	762,06
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%	+0,80%	2,031%	64.654,50	64.835,44	180,94
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%	+0,80%	2,337%	75.915,60	75.877,64	-37,96
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%	+0,80%	2,350%	128.202,49	127.875,16	-327,33
				TOTAL INTERESES AÑO	510.571,12	511.148,83	577,71

2012					Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%	+0,80%	2,169%	122.573,81	122.910,29	336,48
2º Trimestre	Acuerdo 3 meses 28,03,2012	1,600%		1,600%	38.253,98	38.253,32	-0,66
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%	+0,80%	1,452%	37.463,87	37.520,68	56,81
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%	+0,80%	1,021%	27.174,16	27.248,61	74,45
				TOTAL INTERESES AÑO	225.465,82	225.932,90	467,08

2013					Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%	+0,75%	0,935%	25.106,10	23.831,68	-1.274,42
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%	+0,75%	0,962%	45.719,13	45.814,18	95,05
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%	+0,75%	0,969%	42.866,63	42.864,98	-1,65
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%	+0,75%	0,974%	59.673,52	59.673,52	0,00
				TOTAL INTERESES AÑO	173.365,39	172.184,36	-1.181,03

2014					Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%	+0,75%	1,043%	126.108,08	126.108,08	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%	+0,75%	1,060%	75.560,38	75.538,89	-21,49
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%	+0,75%	0,957%	40.410,75	40.462,05	51,30
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%	+0,75%	0,833%	149.187,97	149.187,97	0,00
				TOTAL INTERESES AÑO	391.267,17	391.296,99	29,82

BANESTO

0030 1104 0870126271

2011		euribor	Acuerdo	Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%	+0,20%	78.504,03	78.550,74	46,71
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%	+0,20%	34.594,99	34.591,77	-3,22
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%	+0,20%	10.697,40	10.738,59	41,19
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%	+0,20%	15.359,19	13.920,49	-1.438,70
		TOTAL INTERESES AÑO		139.155,61	137.801,59	-1.354,02

2012		euribor	Acuerdo	Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		36.455,90	37.036,56	580,66
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		7.155,05	7.333,59	178,54
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		4.497,23	4.518,20	20,97
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		5.302,12	5.368,79	66,67
		TOTAL INTERESES AÑO		53.410,30	54.257,14	846,84

2013		euribor	Acuerdo	Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		4.800,71	4.807,67	6,96
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		6.128,71	6.115,04	-13,67
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		4.343,40	4.401,24	57,84
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		10.317,65	10.317,08	-0,57
		TOTAL INTERESES AÑO		25.590,46	25.641,03	50,57

2014		euribor	Acuerdo	Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		12.507,60	12.479,17	-28,43
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		2.792,63	2.788,72	-3,91
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		17,01	17,23	0,22
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%			2,02	2,02
		TOTAL INTERESES AÑO		15.317,25	15.287,14	-30,11

BANKIA

2038 0972 17 6400005583

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%+0,85%	1,07%	4.963,62	4.977,55	13,93
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%+0,85%	1,07%	0,00	0,00	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		4.963,62	4.977,55	13,93

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%+0,55	0,76%		3.151,31	-0,01
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO		3.151,32	3.151,31	-0,01

BANKIA

ES98 2038 0972 17 6400000420

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%+0,85%	1,035%	3.870,14	60.639,62	56.769,48
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%+0,85%	1,06%	35.223,50	33.165,31	-2.058,19
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%+0,85%	1,07%	17.147,73	17.195,85	48,12
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%+0,85%	1,07%	53.998,73	18.500,48	-35.498,25
		TOTAL INTERESES AÑO		110.240,10	129.501,26	19.261,16

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%+0,70%	0,993%	131.771,45	131.771,45	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,31%+0,70%	1,01%	71.576,24	71.576,24	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%+0,55%	0,76%	9.537,03	9.456,80	-80,23
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%+0,45%	0,53%	9.339,89	9.339,89	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		222.224,61	222.144,38	-80,23

BANKINTER

ES88 0128 948002 0100002583

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Por contrato	Euribor 31/12/2010	1,013%+0,20%	51.289,06	51.176,97	-112,09
2º Trimestre	Por contrato	Euribor 31/03/2011	1,231%+0,20%	18.208,20	18.188,71	-19,49
3º Trimestre	Por contrato	Euribor 30/06/2011	1,537%+0,30%	55.025,82	56.876,99	1.851,17
4º Trimestre	Por contrato	Euribor 30/09/2011	1,55%+0,30%	168.363,80	169.171,10	807,30
			TOTAL INTERESES AÑO	292.886,88	295.413,77	2.526,89

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Por contrato	Euribor 31/12/2011	1,369%+0,30%	118.502,05	121.169,42	2.667,37
2º Trimestre	Por contrato	Euribor 31/03/2011	0,787%+0,30%	25.593,06	25.858,40	265,34
3º Trimestre	Por contrato	Euribor 30/06/2011	0,652%+0,30%	19.374,92	19.394,45	19,53
4º Trimestre	Por contrato	Euribor 30/09/2011	0,221%+0,30%	24.298,88	24.507,48	208,60
			TOTAL INTERESES AÑO	187.768,91	190.929,75	3.160,84

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Por contrato	Euribor 31/12/2012	0,185%+0,30%	13.444,91	13.447,77	2,86
2º Trimestre	Por contrato	Euribor 31/03/2013	0,212%+0,30%	17.136,96	17.732,94	595,98
3º Trimestre	Por contrato	Euribor 30/06/2013	0,219%+0,30%	21.211,05	21.161,49	49,56
4º Trimestre	Por contrato	Euribor 30/09/2013	0,224%+0,30%	36.410,74	36.358,41	-52,33
			TOTAL INTERESES AÑO	88.203,66	88.700,61	596,07

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Por contrato	Euribor 31/12/2013	0,293%+0,30%	32.383,86	32.974,30	590,44
2º Trimestre	Por contrato	Euribor 31/03/2014	0,310%+0,30%	23.297,63	23.712,23	414,60
3º Trimestre	Por contrato	Euribor 30/06/2014	0,207%+0,30%	5.253,70	5.262,92	9,22
4º Trimestre	Por contrato	Euribor 30/09/2014	0,083%+0,30%	4.955,27	4.864,25	-91,02
			TOTAL INTERESES AÑO	65.890,47	66.813,70	923,23

BBVA

ES49 0182 5925 87 0000431429

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%		35.920,24	35.920,23	-0,01
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%		30.556,49	30.693,72	137,23
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%		24.668,19	24.667,13	-1,06
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%		42.675,90	42.531,37	-144,53
		TOTAL INTERESES AÑO		133.820,82	133.812,45	-8,37

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		111.255,14	112.864,14	1.609,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		31.932,95	31.125,48	-807,47
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		15.879,32	15.991,92	112,60
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		7.744,83	7.744,83	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		166.812,23	167.726,37	914,14

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		11.114,22	11.140,34	26,12
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		7.782,63	7.783,88	1,25
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		9.809,07	11.008,49	1.199,42
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		11.290,79	11.290,79	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		39.996,72	41.223,50	1.226,78

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		23.818,04	23.747,47	-70,57
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		21.251,28	22.793,27	1.541,99
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		7.700,55	8.124,56	424,01
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		6.710,07	6.811,42	101,35
		TOTAL INTERESES AÑO		59.479,94	61.476,72	1.996,78

BBVA

ES58 0182 5925 85 0200000038

2011		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%		29.067,36	29.067,36	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%		19.140,42	19.139,39	-1,03
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%		22.156,74	22.156,74	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%		29.209,82	25.501,88	-3.707,94
		TOTAL INTERESES AÑO		99.574,34	95.865,37	-3.708,97
2012		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		40.798,10	41.334,53	536,43
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		3.642,54	3.642,54	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		8.103,00	8.103,00	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		989,16	989,16	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		53.532,80	54.069,23	536,43
2013		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		1.890,03	1.890,03	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		1.501,08	1.501,08	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		687,96	687,96	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		4.523,48	4.523,48	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		8.602,55	8.602,55	0,00
2014		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		5.432,57	5.432,57	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		957,23	957,23	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		637,39	637,39	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		2.554,07	2.554,07	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		9.581,26	9.581,26	0,00

BBVA

0182 5925 0200000045

2011		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2010	1,026%		99,71	99,71	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2011	1,096%		11.326,31	11.325,97	-0,34
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2011	1,434%		567,83	567,83	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2011	1,543%		132,50	117,37	-15,13
		TOTAL INTERESES AÑO		12.126,35	12.110,88	-15,47

2012		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2012	1,469%		185,80	188,25	2,45
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2012	0,967%		658,78	658,78	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2012	0,665%		526,18	526,18	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2012	0,276%		242,00	242	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		1.612,76	1.615,21	2,45

2013		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2012	0,190%		52,15	52,15	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2013	0,206%		38,65	38,65	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2013	0,200%		62,48	62,48	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2013	0,225%		32,71	32,71	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		185,99	185,99	0,00

2014		euribor		Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2013	0,236%		135,24	135,24	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2014	0,288%		42,03	42,03	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2014	0,309%		60,11	60,11	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2014	0,159%		3,45	3,45	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		240,83	240,83	0,00

CAIXABAN

2100-1502-59-0200716765

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%		64.484,98	64.147,97	-337,01
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%		36.080,80	36.335,63	254,83
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%		47.462,20	48.503,12	1.040,92
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%		120.460,74	119.286,08	-1.174,66
		TOTAL INTERESES AÑO		268.488,71	268.272,80	-215,91

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		99.879,90	101.311,25	1.431,35
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		22.795,90	22.542,55	-253,35
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		21.185,11	21.314,99	129,88
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		9.132,51	9.137,56	5,05
		TOTAL INTERESES AÑO		152.993,41	154.306,35	1.312,94

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		11.487,87	11.501,02	13,15
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		2.886,25	1.778,57	-1.107,68
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		3.286,89	2.261,20	-1.025,69
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		11.583,99	11.647,06	63,07
		TOTAL INTERESES AÑO		29.244,99	27.187,85	-2.057,14

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		31.550,42	63.695,42	32.145,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		18.068,23	12.144,22	-5.924,01
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		13.587,83	35.404,15	21.816,32
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		14.508,83	134.829,04	120.320,21
		TOTAL INTERESES AÑO		77.715,31	246.072,83	168.357,52

CAIXABAN

2100 9169 08 2200188791

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		135,41	224,13	88,72
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		599,26	557,11	-42,15
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		150,06	149,85	-0,21
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		188,34	191,97	3,63
		TOTAL INTERESES AÑO		1.073,07	1.123,06	49,99

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		740,00	742,93	2,93
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		400,64	395,51	-5,13
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		358,94	366,28	7,34
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		513,37		-513,37
		TOTAL INTERESES AÑO		2.012,95	1.504,72	-508,23

SANOSTRA

2051 SAN01

2010/11				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%		28.103,96	27.853,70	-250,26
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%		29.602,15	29.488,45	-113,70
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%		1.889,39	1.828,08	-61,31
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%		642,08	642,16	0,08
		TOTAL INTERESES AÑO		60.237,58	59.812,39	-425,19

2011/12				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%		3.488,65	3.591,60	102,95
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%		2.109,53	2.066,75	-42,78
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%		277,44	280,90	3,46
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%		1.187,30	1.229,64	42,34
		TOTAL INTERESES AÑO		7.062,91	7.168,89	105,98

2012/13				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		3.309,33	3.926,61	617,28
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		492,00	496,37	4,37
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		4,16	0,00	-4,16
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		0,00	0,00	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		3.805,50	4.422,98	617,48

2012/13				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%		0,00	0,00	0,00
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%		0,00	0,00	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%		7,70	11,96	4,26
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%		55,00	97,96	42,96
		TOTAL INTERESES AÑO		62,71	109,92	47,21

2013/14				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%		4.831,97	3.614,32	-1.217,65
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,310%		1.123,52	788,88	-334,64
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%		13,52	14,44	0,92
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%		312,41	10,99	-301,42
		TOTAL INTERESES AÑO		6.281,42	4.428,63	-1.852,79

CAJA MADRID
2038 0972 600008194

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29.12.2010	1,013%	+0,20%	42.690,55	42.140,56	-549,99
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30.03.2011	1,231%	+0,20%	15.936,88	15.836,86	-100,02
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29.06.2011	1,537%	+0,10%	5.246,06	5.250,46	4,40
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29.09.2011*	1,550%	+0,05%	15.979,30	15.926,00	-53,30
	Euribor a 3 meses 29.09.2011**	1,550%	+0,85%			
		TOTAL INTERESES AÑO		79.852,79	79.153,88	-698,91

* Hasta el 15/11/2011 ** Desde el 16/11/2011

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29.12.2011	1,369%	+0,85%	81.572,64	82.533,65	961,01
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28.03.2012	0,787%	+0,85%	49.016,99	49.032,44	15,45
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27.06.2012	0,652%	+0,85%	11.517,88	11.558,71	40,83
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27.09.2012	0,221%	+0,85%	10.107,59	10.113,44	5,85
		TOTAL INTERESES AÑO		152.215,10	153.238,24	1.023,14

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27.12.2012	0,185%	+0,85%	17.000,75	18.820,56	1.819,81
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27.03.2013	0,212%	+0,85%	27.469,90	25.736,54	-1.733,36
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27.06.2013	0,219%	+0,85%	10.206,23	10.462,14	255,91
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27.09.2013	0,224%	+0,85%	52.528,64	52.730,28	201,64
		TOTAL INTERESES AÑO		107.205,51	107.749,52	544,01

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27.12.2013	0,293%	+0,70%	58.045,44	57.621,45	-423,99
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28.03.2014	0,310%	+0,70%	24.297,35	24.369,52	72,17
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27.06.2014	0,207%	+0,55%	7.555,09	7.555,09	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29.09.2014	0,083%	+0,45%	728,35	865,00	136,65
		TOTAL INTERESES AÑO		90.626,24	90.411,06	-215,18

CAJA RURAL DE CANARIAS / CAJAMAR
3177 0001 18 1004178826 /ES68 3058 6100 98 2738120187

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%+0,70%	1,713%	212.890,82	212.344,85	-545,97
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%+0,70%	1,931%	51.538,53	51.521,63	-16,90
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%+0,95%	2,487%	141.913,74	141.861,21	-52,53
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,55%+0,95%	2,500%	177.227,20	176.796,27	-430,93
		TOTAL INTERESES AÑO		583.570,29	582.523,96	-1.046,33

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%+0,95%	2,319%	210.012,08	211.903,29	1.891,21
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%+1,05%	1,837%	164.847,91	165.417,97	570,06
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%+1,05%	1,702%	132.480,74	132.655,02	174,28
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%+1,05%	1,271%	113.145,11	113.335,75	190,64
		TOTAL INTERESES AÑO		620.485,84	623.312,03	2.826,19

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%+1,15%	1,335%	76.493,62	76.524,18	30,56
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%+1,15%	1,362%	169.582,02	169.457,50	-124,52
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%+1,15%	1,369%	271.359,83	271.359,82	-0,01
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%+1,15%	1,374%	508.902,02	508.892,77	-9,25
		TOTAL INTERESES AÑO		1.026.337,48	1.026.234,27	-103,21

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%+1,15%	1,443%	535.851,84	542.709,03	6.857,19
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,31%+1,15%	1,46%	877.207,04	873.497,93	-3.709,11
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014*	0,207%+1,15%	1,36%	1.742.839,41	1.758.372,10	15.532,69
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014**	0,083%+1,15%	1,23%	1.511.117,74	1.526.584,81	15.467,07
		TOTAL INTERESES AÑO		4.667.016,02	4.701.163,87	34.147,85

* Hasta el 20/11/2014 **Desde el 01/12/2014

CAJASIETE

ES90 3076 9551 98 1004210223

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%+0,80%	1,813%	151.788,37	151.324,67	-463,70
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%+0,80%	2,031%	67.259,07	67.153,61	-105,46
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%+0,75%	2,287%	46.807,07	46.675,94	-131,13
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,55%+0,75%	2,300%	165.141,30	165.522,22	380,92
		TOTAL INTERESES AÑO		430.995,81	430.676,44	-319,37

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%+0,75%	2,119%	139.624,28	140.886,33	1.262,05
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%+0,75%	1,537%	80.087,52	80.645,20	557,68
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%+0,75%	1,402%	72.599,70	72.685,92	86,22
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%+0,75%	0,971%	52.674,07	52.727,19	53,12
		TOTAL INTERESES AÑO		344.985,57	346.944,64	1.959,07

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%+0,75%	0,935%	60.125,25	60.698,04	572,79
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,03,2013	0,212%+0,75%	0,962%	58.506,56	58.490,35	-16,21
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2013	0,219%+0,70%	0,919%	50.046,56	52.768,07	2.721,51
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2013	0,224%+0,70%	0,924%	51.878,38	54.681,44	2.803,06
		TOTAL INTERESES AÑO		220.556,75	226.637,90	6.081,15

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2013	0,293%+0,75%	1,043%	83.388,39	83.306,11	-82,28
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2014	0,31%+0,75%	1,060%	60.920,62	60.907,44	-13,18
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2014	0,207%+0,75%	0,957%	27.465,38	27.494,14	28,76
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2014	0,083%+0,75%	0,833%	106.669,16	106.669,16	0,00
		TOTAL INTERESES AÑO		278.443,55	278.376,85	-66,70

CAJA INSULAR DE AHORROS

2052 8000 74 3500076209

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2010	1,013%	+0,25%	108.286,56	105.310,95	-2.975,61
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,03,2011	1,231%	+0,25%	86.892,07	83.341,75	-3.550,32
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,06,2011	1,537%	+0,25%	105.060,58	100.756,57	-4.304,01
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,09,2011	1,550%	Hasta 15-11 +,25% despues +0,85%	145.621,33	140.319,67	-5.301,66
		TOTAL INTERESES AÑO		445.860,54	429.728,94	-16.131,60

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 29,12,2011	1,369%	+0,85%	231.698,67	233.545,90	1.847,23
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 28,03,2012	0,787%	+0,85%	117.523,52	178.545,79	61.022,27
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,06,2012	0,652%	+0,85%	74.037,40	74.037,97	0,57
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,09,2012	0,221%	+0,85%	59.853,09	59.963,15	110,06
		TOTAL INTERESES AÑO		483.112,68	546.092,81	62.980,13

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 27,12,2012	0,185%	+0,85%	55.692,22	0,00	-55.692,22
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO		55.692,22	0,00	-55.692,22

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

CAJA INSULAR DE AHORROS

2052 8150 70 3500026908

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2010	1,013%	+0,25	326.445,12	333.403,55	6.958,43
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2011	1,231%	+0,25	166.680,86	166.680,86	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2011	1,537%	+0,25	146.715,74	146.715,74	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2011	1,550+0,25% hasta 15 NOV	+0,85 hasta 31 DIC	179.862,31	175.550,37	-4.311,94
		TOTAL INTERESES AÑO		819.704,04	822.350,52	2.646,48

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2011	1,369%	0,850%	289.505,70	291.854,10	2.348,40
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2012	0,787%	0,85%	58.597,42	89.023,69	30.426,27
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2012	0,652%	0,85%	1.283,24	1.283,24	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2012	0,221%	0,85%	937,45	996,09	58,64
		TOTAL INTERESES AÑO		350.323,81	383.157,12	32.833,31

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2012	1,035%		541,50	0,00	-541,50
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO		541,50	0,00	-541,50

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

CAJA INSULAR DE AHORROS

2052 8029 28 3500028803

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2010	1,013%+0,25%		3.575,81	3.574,96	-0,85
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2011	1,231%+0,25%		4.105,25	4.105,25	0,00
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2011	1,537%+0,25%		4.391,94	4.391,94	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2011	HASTA 15 NOV 1,8%	HASTA 31 DIC 2,4%	5.534,33	5.506,49	-27,84
		TOTAL INTERESES AÑO		17.607,33	17.578,64	-28,69

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2011	1,369%+0,85%		9.594,81	9.672,64	77,83
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2012	0,787%+0,85%		2.743,66	4.168,28	1.424,62
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2012	0,652%+0,85%		4.557,93	4.557,93	0,00
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2012	0,221%+0,85%		1.070,81	1.137,80	66,99
		TOTAL INTERESES AÑO		17.967,21	19.536,65	1.569,44

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2012	0,185%+0,85%		918,15	0,00	-918,15
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO		918,15	0,00	-918,15

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS

2065 00 0004 1114002033

2011			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2010	1,013%+0,2%	20.562,35	20.388,30	-174,05
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2011	1,231%+0,2%	11.289,89	11.411,16	121,27
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2011	1,537+0,2%	22.783,06	22.266,57	-516,49
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2011	1,55%+0,2	34.336,32	34.458,96	122,64
		TOTAL INTERESES AÑO	88.971,61	88.524,99	-446,62

2012			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2011	1,369+0,3%	27.850,25	28.581,51	731,26
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2012	0,787+0,3%	11.949,38	11.517,22	-432,16
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2012	0,652+0,3%	4.007,86	4.027,76	19,90
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2012	0,221+0,3%	942,05	2.834,19	1.892,14
		TOTAL INTERESES AÑO	44.749,53	46.960,68	2.211,15

2013			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2012	0,185+0,3%	1.469,79	1.151,42	-318,37
2º Trimestre					
3º Trimestre					
4º Trimestre					
		TOTAL INTERESES AÑO	1.469,79	1.151,42	-318,37

2014			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre					
2º Trimestre					
3º Trimestre					
4º Trimestre					
		TOTAL INTERESES AÑO			

CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS

2065 00 3008 1400776154

2011				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2010	1,013+0,2%		50.222,87	50.235,08	12,21
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2011	1,231+0,2%		5.306,90	4.299,96	-1.006,94
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2011	1,537%		4.896,84	4.903,83	6,99
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2011	1,550%		3.601,84	3.548,48	-53,36
		TOTAL INTERESES AÑO		64.028,45	62.987,35	-1.041,10

2012				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2011	1,369%		1.450,13	1.493,83	43,70
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2012	0,878%		1.215,34	1.224,82	9,48
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2012	0,652%		1.217,03	1.226,96	9,93
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2012	0,221%		303,24	881,81	578,57
		TOTAL INTERESES AÑO		4.185,74	4.827,42	641,68

2013				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2012	0,185%		256,63	319,55	62,92
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO		256,63	319,55	62,92

2014				Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre						
2º Trimestre						
3º Trimestre						
4º Trimestre						
		TOTAL INTERESES AÑO				

CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS

2065 0790 13 2901002584

2011			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2010	1,013%	6.420,78	6.455,62	34,84
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2011	1,231%	3.834,84	3.772,08	-62,76
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2011	1,537%	4.710,10	SIN LIQ.	-4.710,10
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2011	1,550%	5.538,38	5.553,82	15,44
		TOTAL INTERESES AÑO	20.504,10	15.781,52	-4.722,58

2012			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2011	1,369%	9.356,32	9.496,72	140,40
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2012	0,787%	1.774,41	1.735,03	-39,38
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2012	0,652%	1.663,27	1.664,33	1,06
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2012	0,221%	404,42	1.205,63	801,21
		TOTAL INTERESES AÑO	13.198,43	14.101,71	903,28

2013			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2012	0,185%	277,17	254,29	-22,88
2º Trimestre					
3º Trimestre					
4º Trimestre					
		TOTAL INTERESES AÑO	277,17	254,29	-22,88

2014			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre					
2º Trimestre					
3º Trimestre					
4º Trimestre					
		TOTAL INTERESES AÑO			

CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS

2065 01 18891114000037

2011			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2010	1,013%	73.884,80	73.311,69	-573,11
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2011	1,231%	69.281,80	70.903,96	1.622,16
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2011	1,537%	107.384,41	111.035,20	3.650,79
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2011	1,550%	143.005,17	145.852,47	2.847,30
		TOTAL INTERESES AÑO	393.556,18	401.103,32	7.547,14

2012			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2011	1,369%	171.181,94	166.109,66	-5.072,28
2º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,03,2012	0,787%	85.818,96	86.352,56	533,60
3º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,06,2012	0,652%	40.801,68	40.886,98	85,30
4º Trimestre	Euribor a 3 meses 30,09,2012	0,221%	22.810,74	44.745,76	21.935,02
		TOTAL INTERESES AÑO	320.613,32	338.094,96	17.481,64

2013			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre	Euribor a 3 meses 31,12,2012	0,185%	39.659,38	19.331,29	-20.328,09
2º Trimestre					
3º Trimestre					
4º Trimestre					
		TOTAL INTERESES AÑO	39.659,38	19.331,29	-20.328,09

2014			Calculo s/euribor	Calculo banco/ingresado	Diferencia
1º Trimestre					
2º Trimestre					
3º Trimestre					
4º Trimestre					
		TOTAL INTERESES AÑO			

ANEXO IV: Contestación a las alegaciones

ALEGACIONES FORMULADAS POR LA INTERVENCIÓN GENERAL

Alegación: Referida al apartado 2.2.1 del proyecto de informe, denominado “Actas de arqueo, estado de situación de fondos y cuentas corrientes.”

Resumen: Se alega que las diferencias identificadas se deben a una serie de operaciones relacionadas con el gasto de la deuda pública que tienen un procedimiento de contabilización singular, pues el registro contable se produce con posterioridad al cargo en la cuenta del Banco. En el último párrafo de la alegación se manifiesta que en el nuevo sistema del SEFLOGIC se trabajará para que los informes de tesorería permitan “obtener cifras homogéneas y comparables”.

Contestación: La explicación de los descuadres entre los estados contables señalados no puede dar por buena las diferencias detectadas. Tal justificación es aplicable a las diferencias de los años 2011, 2012 y 2013, no así la de 2014 de la que nada se señala. En la alegación de la Dirección General del Tesoro y Política Financiera se afirma que las existencias que arroja el Estado de Situación de Fondos del año 2014 son erróneas. En cualquier caso, las razones aportadas no pueden justificar que las existencias finales del Acta de Arqueo sean diferentes a las del Estado de Situación de Fondos por cuentas corrientes.

Por ello, la alegación formulada no altera el contenido del informe.

ALEGACIONES FORMULADAS POR LA DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA.

Alegación nº 1: Referida al epígrafe 2.2.3., denominado “Contraste de información con las entidades financieras”.

Resumen: En este apartado señala en el proyecto de informe la existencia de multitud de cuentas bancarias de recaudación, de comedores escolares, de habilitaciones de pago, etc., sin movimientos o con saldo igual a cero.

Señala la alegación que se han realizado acciones tendentes a reducir paulatinamente el número de cuentas corrientes. Describe el proceso seguido para la centralización de las cuentas en el SEFLOGIC.

En relación con las cuentas de recaudación, se argumenta que según la normativa vigente, la competencia para la apertura de las cuentas de recaudación corresponde a la Dirección General de Tributos. Está reglado el proceso de apertura de las cuentas, su

funcionamiento para su vaciado en las cuentas operativas del Tesoro y la gestión de las mismas. Se citan diversas Órdenes que regulan los procedimientos de gestión de estas cuentas.

Contestación: Ha de observarse que el apartado que se alega se refiere al contraste de la información con las entidades financieras. Lo que se ha puesto de manifiesto es que existe un vacío de control de las cuentas de recaudación. Aunque la competencia para la apertura de las cuentas corresponde a la D.G. de Tributos, el control sobre el traspaso de los fondos recaudados a las cuentas operativas para posibilitar su disposición, corresponde a la D.G. del Tesoro y política Financiera.

Así pues, el informe no sufre modificación alguna.

Alegación nº 2: Referida a la conclusión nº3.

Resumen: Al igual que se hiciera en las alegaciones de la Intervención General, se manifiesta que las diferencias entre el Estado de Situación de Fondos y las existencias finales del Acta de Arqueo se deben a operaciones transitorias de pago. Se expresa que las existencias finales del Estado de Situación de Fondos del año 2014 son erróneas.

Contestación: Las razones ofrecidas para explicar los descuadres identificados no justifican que sea correcto rendir unas cuentas con ese tipo de diferencias. El cuadro contable del Acta de Arqueo y el Estado de Situación de Fondos es una prueba esencial para asegurar la fiabilidad de las cuentas públicas.

De esta manera, el informe no se ve alterado.

Alegación nº 3: Referida a la conclusión nº4.

Resumen: Se argumenta que el cumplimiento del mandato del artículo 16 de la Orden de 22 de julio de 2004, de la Consejería de Economía y Hacienda, por la que se regula el régimen de funcionamiento y gestión de las cuentas bancarias y de los fondos integrantes en la Tesorería de la Comunidad Autónoma y sus Organismos Autónomos, en sus apartados c), d), f), g), y h), está asegurado porque los datos a que se refieren esos apartados están presentes en los documentos que conforman los expedientes de las cuentas autorizadas. Se hace una detallada descripción de los documentos de los expedientes en los que se encuentran los datos referidos por los apartados citados del artículo 16 en cuestión. Finalmente, manifiestan que en el SEFCAN la informatización del Registro de Cuentas de la Tesorería quedó pendiente de desarrollo por la existencia de otras prioridades, para concluir que se están realizando gestiones para desarrollarlo en el SEFLOGIC.

Contestación: De la lectura de la propia alegación se desprende que no existe un registro completo y singular de las distintas características de una cuenta de la tesorería, tal como exige el artículo 16 de la Orden citada, sino un conjunto de documentos que componen el expediente de apertura de las cuentas, donde constan los referidos datos y características de las cuentas autorizadas.

Por tanto, no se altera el contenido del informe.

Alegación nº 4: Referida a la recomendación nº 2.

Resumen: Manifiestan que, tal como se señalaba en la alegación referida a la conclusión nº4, se ha iniciado el proceso para la informatización del Registro de las Cuentas de la Tesorería.

Contestación: Tal proceso se ha iniciado en el año 2015 con el desarrollo del SEFLOGIC.

Por ello, las alegaciones formuladas no alteran el contenido del informe.

Alegación nº 5: Referida a la recomendación nº 4.

Resumen: Se manifiesta que existe un volumen importante de propuestas de pago a favor de Organismos Autónomos, que no se han hecho efectivas porque los mismos tienen saldo suficiente para atender sus obligaciones. También se alega que las existencias contienen saldos por cuenta de la Administración Central, de carácter extrapresupuestario que no se han abonado.

Han elaborado un cuadro que corrige los saldos finales de fondos de cada ejercicio, minorándolos con los conceptos señalados, obteniendo unas cifras más reducidas, o incluso negativas.

Además se explica que los procedimientos para contratar la financiación ajena son largos y laboriosos, no pudiendo controlar con exactitud el momento preciso en el que se materializa el ingreso procedente de esa financiación.

Finalmente, señalan que la utilización del mecanismo del Fondo para el Pago a Proveedores, también incrementa el endeudamiento.

Contestación: Las propias alegaciones señalan que no se libran las propuestas de pago a favor de los Organismos Autónomos porque detentan fondos suficientes para hacer frente a sus obligaciones. Por tanto, si el análisis de esta cuestión se realizara de manera consolidada, considerando la totalidad de los fondos disponibles de los Organismos

Autónomos, más los fondos de la propia Tesorería General, el importe final de existencias sería mucho mayor, lo cual refuerza la recomendación alegada.

Aun siendo cierto que los procedimientos de contratación de la financiación ajena son largos y laboriosos, se considera posible ajustar el volumen de contratación de financiación ajena. Cada Euro solicitado como recurso ajeno para utilizarlo en el presupuesto vigente, es un Euro de menos para poder disponer en los presupuestos de las generaciones futuras.

Así pues, se mantiene el contenido del informe.

Alegación nº 6: Referida a la recomendación nº 5.

Resumen: Primeramente, la alegación formulada realiza una serie de consideraciones sobre las dificultades de gestión de la tesorería en el periodo 2011-2014, que se enmarca en el contexto de crisis económica de calado en la que se ha visto incurso toda España. Aun así, en el texto del proyecto de informe, se constata que, en general la carga financiera de la financiación ajena, ha sido inferior a la habida en los mercados español y europeo. Así mismo la adhesión a los mecanismos del Fondo de Liquidez y del Fondo de Pago a Proveedores, garantizan una financiación al mínimo coste posible. Por ello, considerando lo anterior, y no existiendo “elementos objetivos que permitan concluir que las decisiones adoptadas se haya optado por contratar operaciones que implicaban una mayor carga financiera para la Comunidad Autónoma”, se solicita se retire la recomendación o se matice, para que no induzca a dudar de las gestiones realizadas.

Contestación: Se constata en los correspondientes apartados del proyecto de informe que la carga financiera de la financiación ajena en los ejercicios analizados ha sido la menor posible para aquel periodo. Que el mantenimiento de la recomendación podría inducir a entender que la gestión de la contratación de la financiación ajena no se ha realizado adecuadamente. Por ello se considera adecuado eliminar la referida recomendación.

En consecuencia se elimina la recomendación nº 5 del informe.

Alegación nº 7: Referida a la recomendación nº 6.

Resumen: Se manifiesta que con las entidades financieras está convenido que las liquidaciones de intereses se realicen en un único abono, siempre que se refieran a un mismo perceptor titular de varias cuentas de un mismo Banco.

Contestación: Precisamente lo que pretende la recomendación es que se modifique esa cláusula de los convenios, de manera que se realice una liquidación de intereses por

cada cuenta, periodo y titular. Ello facilitaría y mejoraría los procesos de control de las referidas liquidaciones.

Por ello, no se alteran el contenido del informe.

Alegación nº 8: Referida a la recomendación nº 7.

Resumen: Se alega que los fondos se distribuyen entre las entidades financieras en función de la rentabilidad que ofertan, pero también en función del volumen de pagos que se ordenan, pues está convenido que los pagos se materializan a través de la entidad en la que el acreedor tiene domiciliado los mismos. Con la implantación del SEFLOGIC y la centralización de los pagos de todos los entes con presupuesto limitativo, los fondos se colocarán en función de las rentabilidades ofrecidas por las entidades financieras y del volumen de recaudación.

Contestación: Con independencia de la necesidad de ordenar los pagos por la entidad bancaria donde el tercero acreedor tenga domiciliado sus cobros, debe asegurarse un equilibrio óptimo en la colocación de los fondos líquidos entre las entidades financieras que ofrezcan mayor rentabilidad y las de domiciliación de los pagos a los acreedores.

Así pues, se mantiene el contenido del informe.

Alegación nº 9: Referida a corrección de errores materiales en el texto del informe.

Resumen: Se señalan dos errores materiales contenidos en el texto del proyecto de informe, referidos a cuadros que figuran en el apartado 2.6.1. del proyecto de informe.

Contestación: Se trata de errores materiales que es preciso corregir.

Así que, se corrige la cifra que figura en el primer cuadro de la página 27 del proyecto de informe, referido a BANCA CIVICA, LINEA DE CREDITO, figurando el 3,681%, y en consecuencia el texto que figura al final del cuadro se sustituye por el siguiente: “Se ha comprobado que el tipo aplicado por la entidad bancaria, para el préstamo ICO, es mayor que la media aritmética de los tipos de los mercados español y europeo de esos años”.

Así mismo, el cuadro que figura al final de la página 30 del proyecto de informe, correspondiente al BANCO DE SANTANDER, en la casilla de vencimiento del primer préstamo de 38.821.000,00 €, vencimiento 05/07/2017, se le añade un asterisco en la casilla de vencimiento, y se señala al pie del cuadro que “este préstamo fue amortizado, anticipadamente, el 27/11/2014”.